

Fecha de Publicación: 6 de Octubre de 2005
Fecha de Información: 04 de Octubre de 2005 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$171,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,2	22,1	19,0	41,1	63,2
15-35	36,6	28,2	19,2	27,6	55,8
36-60	12,0	3,3	3,3	12,0	15,3
61-90	1,9	1,8	1,8	1,9	3,6
91-180	17,0	15,8	15,8	17,0	32,8
>180	-	1,1	1,1	-	1,1
Total	111,7	72,2	60,1	99,6	171,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,1 %	1,9 %
15-35	0,9 %	-0,6 %
36-60	0,2 %	-0,1 %
61-90	1,1 %	0,8 %
91-180	0,8 %	0,7 %
>180	1,8 %	1,5 %
Total	0,5 %	0,6 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	3 al 7 de Octubre				10 al 14 de Octubre				17 al 21 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	15	98	760	454	28	158	480	317	4	72	472	411
Real	98	15	116	421	157	26	111	274	72	4	265	326
Total	113	113	875	875	184	184	591	591	76	76	737	737

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 5 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.