

Fecha de Publicación: 10 de Octubre de 2005
Fecha de Información: 06 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\$295,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,7\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	27,0	40,0	34,0	21,0	61,0
15-35	84,5	84,6	74,6	74,5	159,1
36-60	30,4	20,6	0,6	10,4	31,0
61-90	15,3	18,1	13,1	10,3	28,3
91-180	7,2	0,2	0,2	7,2	7,4
>180	8,7	0,1	0,1	8,7	8,8
Total	172,9	163,6	122,6	131,9	295,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	52	160	510	335	8	72	668	448
Real	98	15	116	421	159	50	117	291	72	8	296	517
Total	113	113	875	875	211	211	627	627	80	80	965	965

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 7 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.