

Fecha de Publicación: 12 de Octubre de 2005
Fecha de Información: 10 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\$127,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14,7	3,1	0,4	12,0	15,0
15-35	69,0	57,6	15,6	27,0	84,6
36-60	2,1	9,1	9,1	2,1	11,1
61-90	3,2	0,2	0,2	3,2	3,5
91-180	10,0	13,2	3,2	-	13,2
>180	-	0,0	0,0	-	0,0
Total	99,0	83,2	28,5	44,3	127,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,4 %	13,2 %
15-35	-0,5 %	-1,5 %
36-60	0,0 %	1,0 %
61-90	0,6 %	0,5 %
91-180	1,0 %	0,8 %
>180	2,7 %	2,7 %
Total	0,9 %	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	10 al 14 de Octubre				17 al 21 de Octubre				24 al 28 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	57	170	548	356	8	73	703	464	4	103	469	403
Real	168	55	120	311	73	8	297	536	103	4	241	307
Total	225	225	667	667	81	81	1000	1000	107	107	709	709

* 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 11 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.