

Fecha de Publicación: 13 de Octubre de 2005
Fecha de Información: 11 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\$143,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -1,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	19,1	13,5	9,5	15,1	28,6
15-35	37,9	18,0	15,0	34,9	52,9
36-60	15,3	1,8	1,8	15,3	17,1
61-90	7,6	22,4	22,4	7,6	30,0
91-180	7,1	1,6	1,6	7,1	8,7
>180	4,3	1,6	1,6	4,3	5,9
Total	91,3	59,0	52,0	84,3	143,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,6 %	-9,5 %
15-35	0,2 %	0,2 %
36-60	-0,3 %	-1,1 %
61-90	0,3 %	0,4 %
91-180	2,3 %	2,5 %
>180	1,7 %	1,5 %
Total	-0,1 %	-1,7 %

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	58	170	550	364	8	73	714	468	4	103	476	405
Real	168	56	125	312	73	8	301	547	103	4	241	312
Total	226	226	675	675	81	81	1015	1015	107	107	716	716

* 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 12 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.