

Fecha de Publicación: 14 de Octubre de 2005
Fecha de Información: 12 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\$212,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24,2	23,0	6,0	7,2	30,2
15-35	55,9	122,5	92,5	25,9	148,4
36-60	0,8	5,1	5,1	0,8	5,9
61-90	8,7	15,3	15,3	8,7	24,0
91-180	1,1	2,5	2,5	1,1	3,5
>180	0,0	0,2	0,2	0,0	0,2
Total	90,7	168,5	121,5	43,7	212,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	363	9	73	737	491	4	103	504	429
Real	168	56	125	312	73	8	307	554	103	4	241	316
Total	226	226	675	675	81	81	1045	1045	107	107	744	744

* 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 13 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.