

Fecha de Publicación: 18 de Octubre de 2005
 Fecha de Información: 13 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\$343,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	19,3	17,9	7,9	9,3	27,2
15-35	133,6	156,2	120,2	97,6	253,8
36-60	46,6	4,3	0,3	42,6	46,8
61-90	6,7	2,0	2,0	6,7	8,7
91-180	0,9	0,2	0,2	0,9	1,1
>180	6,0	0,0	0,0	6,0	6,0
Total	213,1	180,5	130,5	163,1	343,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	59	170	550	363	9	73	751	502	4	103	509	445
Real	168	57	125	312	73	8	308	558	103	4	258	321
Total	227	227	675	675	81	81	1060	1060	107	107	767	767

* 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 14 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.