

Fecha de Publicación: 19 de Octubre de 2005
Fecha de Información: 14 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\$195,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	28,2	26,2	11,2	13,2	39,5
15-35	46,2	83,4	65,4	28,2	111,7
36-60	0,2	37,2	37,2	0,2	37,4
61-90	0,9	3,2	3,2	0,9	4,1
91-180	0,1	1,1	1,1	0,1	1,3
>180	0,9	0,2	0,2	0,9	1,1
Total	76,5	151,4	118,4	43,5	195,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,0 %	2,5 %
15-35	1,1 %	1,3 %
36-60	1,4 %	2,6 %
61-90	1,4 %	1,7 %
91-180	1,6 %	1,6 %
>180	2,0 %	2,1 %
Total	1,8 %	1,8 %

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	72	769	514	4	103	521	460
Real	169	57	125	312	72	9	315	571	103	4	262	323
Total	227	227	675	675	81	81	1085	1085	107	107	783	783

* 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 17 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.