

Fecha de Publicación: 20 de Octubre de 2005
Fecha de Información: 18 de Octubre de 2005¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$168,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	28,6	15,5	3,5	16,6	32,1
15-35	46,8	82,1	71,1	35,8	118,0
36-60	-	4,0	4,0	-	4,0
61-90	8,4	2,8	2,8	8,4	11,2
91-180	-	2,5	2,5	-	2,5
>180	-	0,3	0,3	-	0,3
Total	83,9	107,2	84,2	60,9	168,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,6 %	4,6 %
15-35	1,9 %	2,7 %
36-60	2,4 %	1,8 %
61-90	1,7 %	1,9 %
91-180	2,2 %	2,2 %
>180	3,1 %	3,2 %
Total	1,9 %	3,0 %

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	17 al 21 de Octubre				24 al 28 de Octubre				31 de Oct. al 4 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	10	72	779	528	6	103	534	461	7	141	369	187
Real	72	10	318	568	103	6	263	336	140	7	91	273
Total	82	82	1096	1096	109	109	797	797	147	147	460	460

* 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 19 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.