

Fecha de Publicación: 21 de Octubre de 2005
Fecha de Información: 19 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\$181,0 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	14,3	16,5	6,5	4,3	20,8
15-35	74,5	61,6	44,3	57,2	118,8
36-60	0,2	0,8	0,8	0,2	1,0
61-90	18,4	14,8	14,8	18,4	33,2
91-180	0,0	1,2	1,1	-	1,2
>180	6,0	0,0	0,0	6,0	6,0
Total	113,4	94,9	67,6	86,1	181,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,4 %	2,5 %
15-35	1,6 %	1,4 %
36-60	0,7 %	1,0 %
61-90	2,0 %	2,6 %
91-180	2,2 %	2,0 %
>180	2,6 %	2,2 %
Total	1,7 %	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	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	527	7	103	537	467	7	142	379	200
Real	72	10	316	568	103	7	269	339	141	7	95	273
Total	83	83	1095	1095	110	110	806	806	149	149	473	473

* 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 20 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.