

Fecha de Publicación: 13 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 09 de Septiembre 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\$260,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -1,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	57,7	27,7	7,7	37,7	65,5
15-35	44,8	70,4	66,4	40,8	111,1
36-60	7,1	4,1	4,1	7,1	11,3
61-90	0,9	0,1	0,1	0,9	1,1
91-180	25,3	36,8	36,5	25,1	61,8
>180	9,2	0,5	0,5	9,2	9,7
Total	145,1	139,6	115,3	120,8	260,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,5 %	-2,1 %
15-35	-1,2 %	-1,0 %
36-60	0,0 %	0,9 %
61-90	0,1 %	-0,1 %
91-180	0,9 %	-0,6 %
>180	1,9 %	1,8 %
Total	-0,5 %	-1,0 %

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	5 al 9 de Septiembre				12 al 16 de Septiembre				19 al 23 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	9	180	519	376	25	177	921	596	5	76	390	382
Real	180	8	215	358	177	25	291	615	75	5	274	283
Total	188	188	734	734	202	202	1212	1212	81	81	665	665

* 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 12 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.