

Fecha de Publicación: 15 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 13 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\$142,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	39,1	49,8	14,8	4,1	53,9
15-35	1,1	46,2	46,2	1,1	47,4
36-60	4,0	6,2	6,2	4,0	10,2
61-90	1,3	7,1	7,1	1,3	8,4
91-180	20,3	0,8	0,6	20,1	20,9
>180	0,8	1,2	1,0	0,6	1,8
Total	66,6	111,4	76,0	31,2	142,6

* 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	1,1 %	2,1 %
36-60	1,7 %	0,2 %
61-90	0,9 %	2,0 %
91-180	0,7 %	0,6 %
>180	1,9 %	2,4 %
Total	0,9 %	0,0 %

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	12 al 16 de Septiembre				19 al 23 de Septiembre				26 al 30 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	24	176	945	620	5	79	491	462	3	69	405	358
Real	175	24	291	616	78	5	288	316	69	3	281	328
Total	200	200	1236	1236	84	84	779	779	71	71	686	686

* 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 14 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.