

Fecha de Publicación: 16 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 14 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\$231,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	66,4	35,7	25,7	56,4	92,1
15-35	34,0	35,0	14,0	13,0	48,0
36-60	5,0	7,8	2,8	-	7,8
61-90	17,1	15,4	1,4	3,1	18,5
91-180	30,0	8,5	8,5	30,0	38,5
>180	25,8	0,8	0,8	25,8	26,6
Total	178,2	103,2	53,2	128,2	231,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,4 %	0,5 %
15-35	-0,6 %	0,2 %
36-60	0,2 %	-0,4 %
61-90	0,9 %	0,6 %
91-180	1,3 %	0,5 %
>180	2,3 %	1,9 %
Total	0,7 %	0,6 %

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	175	945	620	44	94	507	471	3	71	423	374
Real	174	24	291	616	93	44	296	332	70	3	282	332
Total	199	199	1236	1236	138	138	803	803	73	73	706	706

* 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 15 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.