

Fecha de Publicación: 21 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 19 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\$237,3 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	99,4	95,1	3,1	7,4	102,6
15-35	51,4	76,6	36,0	10,8	87,4
36-60	9,6	5,5	2,5	6,6	12,1
61-90	2,3	4,4	4,4	2,3	6,6
91-180	-	1,9	1,9	-	1,9
>180	26,7	0,1	0,1	26,7	26,8
Total	189,4	183,6	48,0	53,8	237,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,1 %	5,1 %
15-35	1,4 %	1,6 %
36-60	0,8 %	0,6 %
61-90	1,4 %	1,0 %
91-180	1,7 %	1,5 %
>180	2,0 %	1,7 %
Total	2,8 %	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	19 al 23 de Septiembre				26 al 30 de Septiembre				3 al 7 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	46	92	554	520	5	71	538	490	6	75	523	256
Real	91	46	303	337	71	5	298	346	75	6	82	349
Total	137	137	856	856	76	76	835	835	82	82	605	605

* 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 septiembre se presenta la proyección de vencimientos.