

Fecha de Publicación: 22 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 20 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\$222,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,3\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	31,4	10,0	5,0	26,4	36,4
15-35	59,6	54,6	33,6	38,6	93,3
36-60	2,2	1,5	1,5	2,2	3,7
61-90	15,5	4,7	4,7	15,5	20,2
91-180	23,0	21,0	6,0	8,0	29,0
>180	11,0	28,7	28,7	11,0	39,7
Total	142,7	120,6	79,6	101,7	222,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,8 %	-4,1 %
15-35	0,7 %	-0,2 %
36-60	0,2 %	-0,2 %
61-90	0,5 %	0,5 %
91-180	0,8 %	1,1 %
>180	1,9 %	1,3 %
Total	1,0 %	-0,3 %

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	559	525	6	71	562	495	6	75	535	271
Real	91	45	303	337	71	5	303	371	75	6	91	354
Total	137	137	862	862	77	77	865	865	82	82	626	626

* 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 21 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.