

Fecha de Publicación: 23 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 21 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\$247,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,9	28,1	7,1	23,9	52,0
15-35	64,8	98,5	68,5	34,8	133,3
36-60	-	10,9	10,9	-	10,9
61-90	16,2	16,2	5,2	5,2	21,4
91-180	24,0	2,0	2,0	24,0	26,0
>180	-	3,5	3,5	-	3,5
Total	149,9	159,2	97,2	87,9	247,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	45	92	559	525	6	71	593	521	6	75	580	288
Real	91	45	303	337	71	5	308	380	75	6	93	384
Total	136	136	862	862	77	77	901	901	82	82	673	673

* 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 22 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.