

Fecha de Publicación: 27 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 23 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\$111,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	8,7	8,5	0,5	0,7	9,1
15-35	44,5	29,1	23,1	38,5	67,7
36-60	0,1	6,5	6,5	0,1	6,6
61-90	3,0	19,3	18,6	2,3	21,6
91-180	0,3	4,1	4,1	0,3	4,3
>180	-	2,0	2,0	-	2,0
Total	56,6	69,5	54,8	41,9	111,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	5	74	632	561	7	79	616	321
Real	91	45	303	337	73	5	310	381	79	7	93	387
Total	137	137	862	862	79	79	942	942	86	86	709	709

* 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 26 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.