

Fecha de Publicación: 28 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 26 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\$147,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	67,4	48,7	2,7	21,4	70,1
15-35	24,1	37,6	21,6	8,1	45,7
36-60	0,0	3,0	3,0	0,0	3,1
61-90	1,1	1,7	1,7	1,1	2,7
91-180	10,0	15,6	15,6	10,0	25,6
>180	0,1	0,1	0,1	-	0,1
Total	102,7	106,7	44,7	40,6	147,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,5 %	1,8 %
15-35	0,2 %	0,2 %
36-60	1,0 %	0,6 %
61-90	0,7 %	0,7 %
91-180	1,6 %	0,9 %
>180	2,4 %	2,4 %
Total	0,7 %	1,1 %

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	26 al 30 de Septiembre				3 al 7 de Octubre				10 al 14 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	6	75	664	575	6	79	649	355	11	137	342	212
Real	75	6	311	400	79	6	93	387	135	10	108	238
Total	81	81	975	975	86	86	742	742	146	146	450	450

* 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 27 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.