

Fecha de Publicación: 29 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 27 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\$312,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	41,2	42,6	8,6	7,2	49,8
15-35	81,4	83,8	20,8	18,4	102,2
36-60	70,0	49,2	29,2	50,0	99,2
61-90	34,2	3,5	3,5	34,2	37,7
91-180	3,0	19,6	19,6	3,0	22,6
>180	-	1,0	1,0	-	1,0
Total	229,8	199,6	82,6	112,8	312,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	5	77	677	587	9	79	673	383	11	137	372	240
Real	77	5	311	401	79	9	99	389	135	10	108	240
Total	82	82	988	988	88	88	772	772	146	146	481	481

* 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 28 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.