

Fecha de Publicación: 2 de Septiembre de 2005

Fecha de Información: 31 de Agosto 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\$128,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	32,5	10,6	10,6	32,5	43,0
15-35	54,3	10,4	7,4	51,3	61,8
36-60	2,1	0,5	0,5	2,1	2,6
61-90	0,7	3,4	3,1	0,4	3,9
91-180	14,4	3,0	3,0	14,4	17,4
>180	-	0,0	0,0	-	0,0
Total	104,0	28,0	24,7	100,7	128,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

Sector	29 de Ago. al 2 de Septiembre				5 al 9 de Septiembre				12 al 16 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	7	63	487	290	5	177	444	332	13	154	655	390
Real	63	6	119	316	176	5	182	293	153	13	253	518
Total	69	69	606	606	181	181	625	625	167	167	908	908

* 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 1 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.