

Fecha de Publicación: 05 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 01 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\$167,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	33,7	19,6	11,6	25,7	45,3
15-35	40,8	41,2	35,2	34,8	76,0
36-60	6,1	8,0	8,0	6,1	14,1
61-90	7,4	10,0	9,3	6,7	16,7
91-180	5,0	8,9	8,9	5,0	13,9
>180	-	1,3	1,3	-	1,3
Total	92,9	89,1	74,4	78,2	167,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	450	333	13	166	686	407
Real	63	6	119	316	176	5	183	299	166	13	261	541
Total	69	69	606	606	181	181	632	632	179	179	947	947

* 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 2 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.