

Fecha de Publicación: 06 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 02 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\$236,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	69,4	19,9	19,9	69,4	89,4
15-35	42,0	22,8	16,9	36,1	58,9
36-60	3,3	9,6	7,3	1,0	10,6
61-90	21,2	0,7	0,7	21,2	21,9
91-180	20,2	18,7	18,7	20,2	38,9
>180	16,0	0,4	0,4	16,0	16,4
Total	172,1	72,2	63,9	163,9	236,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	6	182	503	350	16	167	698	407
Real	63	6	119	316	182	6	200	353	166	16	261	552
Total	69	69	606	606	188	188	702	702	183	183	959	959

* 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 5 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.