

Fecha de Publicación: 07 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 05 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\$78,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	17,7	15,2	0,2	2,7	18,0
15-35	7,0	13,7	12,7	6,0	19,7
36-60	3,0	16,6	16,6	3,0	19,6
61-90	-	7,9	7,9	-	7,9
91-180	12,0	6,7	1,7	7,0	13,7
>180	-	0,0	0,0	-	0,0
Total	39,7	60,1	39,1	18,7	78,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	5 al 9 de Septiembre				12 al 16 de Septiembre				19 al 23 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	6	181	508	355	16	167	710	417	3	76	322	372
Real	181	6	200	353	166	16	261	555	75	2	266	216
Total	187	187	708	708	183	183	971	971	78	78	588	588

* 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 6 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.