

Fecha de Publicación: 08 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 06 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\$217,8 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	36,6	51,4	33,4	18,6	70,0
15-35	34,2	58,5	37,5	13,2	71,7
36-60	17,2	17,4	17,4	17,2	34,6
61-90	11,9	3,0	2,9	11,8	14,8
91-180	9,5	6,2	4,2	7,5	13,8
>180	1,2	11,8	11,8	1,2	13,0
Total	110,6	148,3	107,2	69,5	217,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,0 %	1,1 %
15-35	0,3 %	0,3 %
36-60	0,7 %	0,8 %
61-90	0,9 %	0,6 %
91-180	1,2 %	1,1 %
>180	1,8 %	0,4 %
Total	0,8 %	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	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	7	181	520	377	22	167	723	446	3	76	328	379
Real	181	7	216	359	166	21	278	555	76	3	273	222
Total	188	188	736	736	188	188	1001	1001	78	78	601	601

* 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 7 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.