

Fecha de Publicación: 12 de Septiembre de 2005
Fecha de Información: 08 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\$343,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	128,5	67,3	5,3	66,5	133,8
15-35	102,8	38,6	31,6	95,8	134,4
36-60	14,1	0,1	0,1	14,1	14,3
61-90	19,0	4,6	4,6	19,0	23,6
91-180	30,3	3,4	3,4	30,3	33,7
>180	1,5	2,4	2,4	1,5	3,9
Total	296,2	116,5	47,5	227,2	343,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	16,5 %	13,2 %
15-35	1,1 %	-0,5 %
36-60	0,2 %	-1,1 %
61-90	0,7 %	0,7 %
91-180	0,4 %	0,5 %
>180	1,1 %	2,0 %
Total	4,2 %	5,0 %

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	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	9	180	519	376	22	172	885	575	4	76	373	381
Real	180	8	215	358	172	22	290	599	76	3	273	265
Total	188	188	734	734	194	194	1175	1175	79	79	646	646

* 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 9 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.