

Fecha de Publicación: 12 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 10 de Agosto 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\$583,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	47,2	21,1	7,1	33,2	54,3
15-35	211,8	89,9	34,4	156,3	246,2
36-60	17,6	8,3	3,3	12,6	20,9
61-90	105,7	11,4	6,4	100,7	112,1
91-180	108,6	36,9	30,9	102,6	139,5
>180	10,5	10,4	0,4	0,5	10,8
Total	501,4	178,1	82,6	405,8	583,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	10,2 %	6,1 %
15-35	3,4 %	0,4 %
36-60	0,6 %	-1,6 %
61-90	2,0 %	-0,4 %
91-180	2,1 %	0,8 %
>180	3,5 %	3,6 %
Total	3,7 %	0,9 %

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	8 al 12 de Agosto				15 al 19 de Agosto				22 al 26 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	7	118	686	564	19	75	503	494	10	56	434	374
Real	118	7	269	391	75	18	295	304	55	9	203	263
Total	125	125	955	955	93	93	798	798	65	65	637	637

* 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 11 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.