

Fecha de Publicación: 17 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 12 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\$199,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	8,7	34,7	34,7	8,7	43,4
15-35	11,0	107,9	104,9	8,0	115,9
36-60	5,4	13,3	13,3	5,4	18,7
61-90	0,1	4,6	4,6	0,1	4,6
91-180	3,3	13,8	13,8	3,3	17,1
>180	-	0,1	0,1	-	0,1
Total	28,5	174,4	171,4	25,5	199,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	115	686	567	19	109	517	502	12	56	463	389
Real	115	7	272	391	108	19	295	310	55	11	211	285
Total	122	122	958	958	127	127	813	813	67	67	674	674

* 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 15 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.