

Fecha de Publicación: 22 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 18 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\$188,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14,9	17,4	6,4	3,9	21,3
15-35	73,3	59,6	31,6	45,3	104,9
36-60	0,8	0,5	0,5	0,8	1,2
61-90	12,0	16,3	11,3	7,0	23,3
91-180	22,1	3,7	3,7	22,1	25,9
>180	12,0	10,0	0,0	2,0	12,0
Total	135,1	107,6	53,6	81,1	188,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	15 al 19 de Agosto				22 al 26 de Agosto				29 de Ago. al 2 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	19	104	523	508	12	51	534	450	5	47	367	224
Real	104	19	296	311	50	11	227	311	47	4	114	258
Total	123	123	819	819	63	63	761	761	52	52	481	481

* 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 19 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.