

Fecha de Publicación: 26 de Agosto de 2005
 Fecha de Información: 24 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\$140,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14,4	0,0	0,0	14,4	14,5
15-35	45,7	53,7	33,7	25,7	79,4
36-60	20,0	2,3	2,3	20,0	22,3
61-90	6,4	8,6	8,6	6,4	15,0
91-180	3,4	5,6	5,6	3,4	9,0
>180	-	0,0	0,0	-	0,0
Total	89,8	70,3	50,3	69,8	140,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	22 al 26 de Agosto				29 de Ago. al 2 de Septiembre				5 al 9 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	13	54	541	457	4	51	462	287	5	181	397	313
Real	53	12	234	317	51	4	116	291	180	4	179	263
Total	66	66	774	774	55	55	578	578	185	185	575	575

* 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 25 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.