

Fecha de Publicación: 29 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 25 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\$105,6 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	19,8	1,0	1,0	19,8	20,8
15-35	33,5	24,6	14,6	23,5	48,1
36-60	14,0	12,9	2,9	4,0	16,9
61-90	0,9	13,6	13,6	0,9	14,6
91-180	0,0	5,2	5,2	0,0	5,3
>180	-	-	-	-	-
Total	68,3	57,3	37,3	48,3	105,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,3 %	-0,3 %
15-35	-0,5 %	-0,1 %
36-60	0,7 %	0,1 %
61-90	1,1 %	1,1 %
91-180	1,8 %	1,7 %
>180	-	-
Total	0,5 %	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	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	480	289	5	181	398	313
Real	53	12	234	317	50	4	118	309	180	4	179	264
Total	66	66	774	774	55	55	598	598	185	185	577	577

* 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 26 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.