

Fecha de Publicación: 30 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 26 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\$174,0 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	27,2	30,7	14,7	11,2	41,9
15-35	56,4	72,2	36,2	20,4	92,6
36-60	0,7	7,2	7,2	0,7	7,9
61-90	11,1	1,3	1,3	11,1	12,4
91-180	0,7	8,2	8,2	0,7	8,9
>180	9,5	0,8	0,8	9,5	10,3
Total	105,6	120,4	68,4	53,6	174,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,4 %	-1,1 %
15-35	0,8 %	0,2 %
36-60	1,0 %	1,0 %
61-90	1,0 %	0,9 %
91-180	2,9 %	3,0 %
>180	2,5 %	2,5 %
Total	1,2 %	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	5	63	488	290	5	181	417	330
Real	53	12	234	317	63	5	119	317	180	5	180	267
Total	66	66	774	774	68	68	607	607	185	185	597	597

* 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 29 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.