

Fecha de Publicación: 31 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 29 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\$147,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	29,9	-	-	29,9	29,9
15-35	25,1	63,8	56,8	18,1	81,8
36-60	0,8	3,3	3,3	0,8	4,1
61-90	2,0	2,6	2,6	2,0	4,6
91-180	9,6	7,3	7,2	9,6	16,8
>180	8,6	1,3	1,3	8,6	9,9
Total	76,0	78,2	71,2	68,9	147,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,5 %	-0,8 %
15-35	0,2 %	0,8 %
36-60	0,3 %	0,7 %
61-90	8,0 %	7,5 %
91-180	2,1 %	2,3 %
>180	2,6 %	2,6 %
Total	1,8 %	1,0 %

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	29 de Ago. al 2 de Septiembre				5 al 9 de Septiembre				12 al 16 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	5	63	488	290	5	177	434	330	13	144	586	389
Real	63	5	119	317	176	5	180	284	143	13	253	450
Total	68	68	607	607	182	182	614	614	156	156	839	839

* 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 30 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.