

Fecha de Publicación: 05 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 03 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\$330,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	48,1	55,3	28,2	20,9	76,2
15-35	86,1	67,0	52,8	71,9	138,9
36-60	18,0	38,0	38,0	18,0	56,0
61-90	21,3	16,6	16,6	21,3	37,8
91-180	12,0	6,0	6,0	12,0	18,0
>180	3,7	0,1	0,1	3,7	3,8
Total	189,1	183,0	141,7	147,8	330,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,7 %	3,9 %
15-35	0,7 %	0,9 %
36-60	1,5 %	2,2 %
61-90	1,8 %	2,0 %
91-180	2,2 %	1,6 %
>180	2,8 %	2,2 %
Total	1,5 %	2,0 %

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	1 al 5 de Agosto				8 al 12 de Agosto				15 al 19 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	6	62	547	347	6	118	643	507	15	74	431	437
Real	62	5	128	328	117	6	247	383	74	14	272	266
Total	67	67	675	675	123	123	890	890	89	89	703	703

* 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 4 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.