

Fecha de Publicación: 8 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 04 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\$175,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	61,3	82,8	22,8	1,3	84,1
15-35	41,5	28,0	23,0	36,5	64,6
36-60	3,1	0,3	0,3	3,1	3,4
61-90	9,0	5,0	-	4,0	9,0
91-180	9,2	6,6	0,1	2,7	9,3
>180	5,0	3,4	0,4	2,0	5,4
Total	129,2	126,1	46,6	49,7	175,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,4 %	2,3 %
15-35	0,9 %	1,1 %
36-60	1,9 %	1,8 %
61-90	1,5 %	1,8 %
91-180	1,9 %	1,6 %
>180	2,9 %	2,4 %
Total	1,5 %	1,8 %

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	5	62	547	347	6	118	680	554	14	74	459	473
Real	62	5	128	328	118	6	259	385	74	14	283	269
Total	67	67	675	675	124	124	939	939	88	88	741	741

* 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 5 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.