

Fecha de Publicación: 09 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 05 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\$174,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24,1	11,3	6,3	19,1	30,4
15-35	42,2	87,3	47,3	2,2	89,5
36-60	33,1	4,4	4,4	33,1	37,5
61-90	7,3	7,5	6,5	6,3	13,8
91-180	2,0	1,6	1,6	2,0	3,6
>180	-	0,1	0,1	-	0,1
Total	108,6	112,3	66,3	62,6	174,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	203,5 %	22,6 %
15-35	1,2 %	1,4 %
36-60	2,0 %	1,7 %
61-90	2,2 %	1,9 %
91-180	2,2 %	2,1 %
>180	2,7 %	3,2 %
Total	67,9 %	5,2 %

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

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	7	118	684	556	18	75	474	481
Real	62	5	128	328	118	7	262	389	75	17	286	279
Total	67	67	675	675	125	125	946	946	92	92	760	760

* 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 8 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.