

Fecha de Publicación: 10 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 08 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\$90,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7,8	1,5	1,5	7,8	9,3
15-35	25,9	24,2	23,2	24,9	49,1
36-60	20,0	24,9	4,9	-	24,9
61-90	1,2	0,2	0,2	1,2	1,5
91-180	2,9	2,9	2,2	2,2	5,1
>180	-	0,2	0,2	-	0,2
Total	57,8	54,0	32,3	36,1	90,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	8 al 12 de Agosto				15 al 19 de Agosto				22 al 26 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	7	118	686	557	18	75	480	481	10	56	349	347
Real	118	7	263	391	75	17	286	285	55	9	192	195
Total	125	125	948	948	92	92	766	766	65	65	542	542

* 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 9 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.