

Fecha de Publicación: 11 de Agosto de 2005
 Fecha de Información: 09 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\$280,4 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	13,5	8,3	8,3	13,5	21,7
15-35	99,7	54,0	30,0	75,7	129,7
36-60	63,5	1,8	1,3	63,0	64,8
61-90	0,5	1,2	1,2	0,5	1,6
91-180	51,3	8,0	8,0	51,3	59,3
>180	2,0	1,3	1,3	2,0	3,3
Total	230,4	74,6	50,1	205,9	280,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,8 %	6,0 %
15-35	1,6 %	1,3 %
36-60	1,8 %	1,5 %
61-90	2,1 %	2,0 %
91-180	2,5 %	1,9 %
>180	3,1 %	2,9 %
Total	2,3 %	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	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	564	18	75	488	483	10	56	359	355
Real	118	7	269	391	75	18	288	293	55	9	196	200
Total	125	125	955	955	93	93	776	776	65	65	555	555

* 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 10 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.