

Fecha de Publicación: 16 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 11 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\$148,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,5\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	34,9	17,6	2,6	19,9	37,5
15-35	24,4	62,3	57,3	19,4	81,7
36-60	4,6	11,8	9,8	2,6	14,5
61-90	1,4	2,9	2,9	1,4	4,3
91-180	0,8	9,3	9,3	0,8	10,1
>180	-	0,0	0,0	-	0,0
Total	66,1	104,0	82,0	44,1	148,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	115	686	567	19	75	517	502	11	56	455	388
Real	115	7	272	391	75	19	295	310	55	10	210	277
Total	122	122	958	958	94	94	812	812	66	66	665	665

* 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 12 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.