

Fecha de Publicación: 18 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 16 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\$147,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 58,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	43,0	17,8	4,8	30,0	47,8
15-35	43,7	55,4	44,4	32,7	88,1
36-60	-	2,2	2,2	-	2,2
61-90	-	2,4	2,4	-	2,4
91-180	-	1,8	1,8	-	1,8
>180	5,0	0,6	0,6	5,0	5,6
Total	91,7	80,2	56,2	67,7	147,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3713,7 %	179,7 %
15-35	1,0 %	0,1 %
36-60	2,0 %	3,6 %
61-90	1,4 %	1,2 %
91-180	2,6 %	2,7 %
>180	2,8 %	2,1 %
Total	1209,2 %	58,4 %

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	15 al 19 de Agosto				22 al 26 de Agosto				29 de Ago. al 2 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	19	104	523	508	12	51	485	405	4	47	328	217
Real	104	19	296	311	50	11	219	300	47	4	114	225
Total	123	123	819	819	62	62	705	705	51	51	442	442

* 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 17 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.