

Fecha de Publicación: 19 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 17 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\$190,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -1,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	49,6	36,0	4,0	17,6	53,6
15-35	44,5	48,5	41,5	37,5	86,0
36-60	8,5	8,1	3,1	3,5	11,5
61-90	18,2	5,5	0,5	13,2	18,6
91-180	13,2	7,5	2,5	8,2	15,7
>180	5,0	0,2	0,2	5,0	5,2
Total	138,9	105,8	51,8	84,9	190,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	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	527	440	4	47	347	218
Real	104	19	296	311	50	11	222	309	47	4	115	244
Total	123	123	819	819	62	62	749	749	52	52	462	462

* 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 18 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.