

Fecha de Publicación: 24 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 22 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\$151,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,0	27,2	7,2	18,0	45,2
15-35	15,2	71,7	70,7	14,2	85,9
36-60	4,7	9,5	9,5	4,7	14,2
61-90	0,4	0,9	0,8	0,3	1,2
91-180	0,3	3,9	3,8	0,2	4,1
>180	-	0,5	0,5	-	0,5
Total	58,6	113,6	92,5	37,5	151,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,2 %	4,8 %
15-35	2,1 %	2,2 %
36-60	2,4 %	2,1 %
61-90	1,5 %	1,2 %
91-180	1,7 %	1,8 %
>180	2,5 %	2,6 %
Total	2,3 %	2,9 %

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	22 al 26 de Agosto				29 de Ago. al 2 de Septiembre				5 al 9 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	13	51	541	457	5	50	420	255	4	181	364	302
Real	51	12	234	317	50	4	115	281	180	4	179	241
Total	64	64	775	775	54	54	536	536	185	185	543	543

* 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 23 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.