

Fecha de Publicación: 25 de Agosto de 2005
Fecha de Información: 23 de Agosto de 2005¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$120,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,2\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	37,4	33,9	1,9	5,4	39,3
15-35	41,4	26,3	15,3	30,4	56,7
36-60	11,7	0,0	0,0	11,7	11,7
61-90	2,1	3,5	2,5	1,1	4,6
91-180	0,8	5,5	5,5	0,8	6,3
>180	0,4	1,7	1,5	0,1	1,8
Total	93,7	70,9	26,6	49,4	120,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	51	454	287	4	181	389	313
Real	51	12	234	317	51	4	116	282	180	4	179	255
Total	64	64	775	775	55	55	570	570	185	185	567	567

* 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 24 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.