

Fecha de Publicación: 29 de Julio de 2005
Fecha de Información: 27 de Julio 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\$183,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	29,4	25,3	11,3	15,4	40,6
15-35	44,8	57,4	31,4	18,8	76,2
36-60	7,0	3,7	3,7	7,0	10,7
61-90	38,9	7,7	1,1	32,3	40,0
91-180	8,2	8,4	2,4	2,2	10,7
>180	5,0	5,6	0,6	-	5,6
Total	133,3	108,1	50,5	75,7	183,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,2 %	0,1 %
15-35	1,4 %	1,2 %
36-60	1,9 %	1,6 %
61-90	2,1 %	1,7 %
91-180	3,7 %	3,0 %
>180	4,2 %	2,6 %
Total	1,8 %	1,3 %

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	25 al 29 de Julio				1 al 5 de Agosto				8 al 12 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	9	28	866	916	5	61	496	318	3	95	494	359
Real	28	9	521	472	61	4	118	297	95	3	173	309
Total	37	37	1387	1387	65	65	614	614	99	99	667	667

* 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 28 de julio se presenta la proyección de vencimientos.