

Fecha de Publicación: 1 de Agosto de 2005
 Fecha de Información: 28 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\$153,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,9	20,2	8,2	26,9	47,1
15-35	45,6	22,0	19,5	43,1	65,1
36-60	-	7,5	7,5	-	7,5
61-90	10,0	9,1	9,1	10,0	19,1
91-180	11,3	11,1	1,1	1,3	12,4
>180	0,2	2,3	2,3	0,2	2,5
Total	106,1	72,2	47,7	81,6	153,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,0 %	1,1 %
15-35	2,3 %	1,5 %
36-60	2,4 %	1,7 %
61-90	2,6 %	1,8 %
91-180	3,0 %	2,9 %
>180	3,6 %	3,1 %
Total	1,9 %	1,5 %

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	511	330	4	96	518	367
Real	28	9	521	472	61	5	118	299	95	3	181	332
Total	37	37	1387	1387	66	66	629	629	99	99	699	699

* 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 29 de julio se presenta la proyección de vencimientos.