

Fecha de Publicación: 8 de Julio de 2005
 Fecha de Información: 06 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\$185,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	31,6	65,6	39,5	5,6	71,1
15-35	67,4	46,6	24,1	44,9	91,4
36-60	0,4	1,9	1,9	0,4	2,3
61-90	7,0	7,8	2,8	2,0	9,8
91-180	5,4	8,6	3,5	0,3	8,9
>180	0,5	1,7	1,7	0,5	2,2
Total	112,3	132,1	73,6	53,7	185,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	49,5 %	0,7 %
15-35	3,7 %	2,5 %
36-60	3,2 %	3,6 %
61-90	3,8 %	4,5 %
91-180	3,5 %	4,0 %
>180	3,8 %	3,7 %
Total	19,9 %	2,0 %

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

Sectores	18 al 22 de Julio				4 al 8 de Julio				11 al 15 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	8	28	535	379	13	47	794	761	20	35	951	881
Real	28	8	161	317	47	13	380	413	34	19	425	495
Total	35	35	696	696	61	61	1174	1174	54	54	1376	1376

* 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 7 de julio se presenta la proyección de vencimientos.