

Fecha de Publicación: 11 de Julio de 2005
Fecha de Información: 07 de Julio 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\$356,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	57,2	84,1	45,6	18,7	102,7
15-35	59,7	61,2	53,2	51,7	112,9
36-60	2,2	24,4	24,4	2,2	26,5
61-90	65,0	5,1	0,1	60,0	65,1
91-180	46,3	7,0	2,0	41,3	48,3
>180	0,5	0,4	0,4	0,5	0,9
Total	230,8	182,2	125,7	174,3	356,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	555	427	13	47	794	761	26	35	991	923
Real	28	8	198	325	47	13	380	413	34	25	437	505
Total	36	36	752	752	61	61	1174	1174	60	60	1428	1428

* 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 8 de julio se presenta la proyección de vencimientos.