

Fecha de Publicación: 12 de Julio de 2005
Fecha de Información: 08 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\$206,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|-------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 52,2 | 52,7 | 16,7 | 16,2 | 68,9 |
| 15-35 | 37,3 | 84,9 | 67,9 | 20,3 | 105,1 |
| 36-60 | 2,3 | 5,3 | 5,3 | 2,3 | 7,6 |
| 61-90 | 11,2 | 13,5 | 2,3 | - | 13,5 |
| 91-180 | 11,2 | 11,2 | 0,2 | 0,2 | 11,5 |
| >180 | - | 0,3 | 0,3 | - | 0,3 |
| Total | 114,1 | 167,9 | 92,7 | 38,9 | 206,8 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 12,0 % | 4,4 % |
| 15-35 | 2,8 % | 2,7 % |
| 36-60 | 3,9 % | 2,7 % |
| 61-90 | 3,2 % | 3,6 % |
| 91-180 | 3,5 % | 3,9 % |
| >180 | 3,4 % | 2,7 % |
| Total | 6,2 % | 3,4 % |

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 | 30 | 588 | 455 | 13 | 47 | 794 | 761 | 28 | 35 | 1008 | 946 |
| Real | 30 | 8 | 204 | 337 | 47 | 13 | 380 | 413 | 34 | 27 | 445 | 507 |
| Total | 38 | 38 | 792 | 792 | 61 | 61 | 1174 | 1174 | 62 | 62 | 1453 | 1453 |

* 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 11 de julio se presenta la proyección de vencimientos.