

Fecha de Publicación: 13 de Julio de 2005
Fecha de Información: 11 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\$251,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	64,6	24,1	6,6	47,1	71,2
15-35	74,1	88,2	55,2	41,1	129,3
36-60	1,3	7,0	7,0	1,3	8,3
61-90	1,0	4,8	4,8	1,0	5,8
91-180	8,7	22,8	18,8	4,7	27,5
>180	-	8,9	8,9	-	8,9
Total	149,8	155,8	101,3	95,3	251,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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				25 al 29 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	589	462	5	27	551	602	35	35	1064	962
Real	30	8	210	337	27	5	349	297	34	34	445	547
Total	38	38	799	799	32	32	900	900	69	69	1509	1509

* 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 12 de julio se presenta la proyección de vencimientos.