

Fecha de Publicación: 14 de Julio de 2005
Fecha de Información: 12 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\$330,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	39,6	67,5	32,5	4,6	72,1
15-35	94,6	86,2	37,2	45,6	131,9
36-60	50,0	7,4	2,4	45,0	52,4
61-90	8,3	6,1	1,1	3,3	9,4
91-180	15,5	15,9	0,9	0,5	16,4
>180	47,2	10,7	0,7	37,2	47,9
Total	255,3	193,9	74,9	136,3	330,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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				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	31	620	522	6	27	577	615	34	34	1072	970
Real	31	8	239	338	27	6	361	323	34	34	447	549
Total	39	39	859	859	32	32	938	938	68	68	1519	1519

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 13 de julio se presenta la proyección de vencimientos.