

Fecha de Publicación: 18 de Julio de 2005
Fecha de Información: 14 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\$212,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	58,6	35,1	6,1	29,6	64,6
15-35	63,0	56,9	19,9	26,0	83,0
36-60	8,2	11,1	3,1	0,2	11,3
61-90	10,1	16,6	6,6	0,1	16,7
91-180	11,6	10,5	0,5	1,6	12,2
>180	24,3	20,4	0,4	4,3	24,7
Total	175,8	150,6	36,6	61,8	212,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	101,7 %	4,0 %
15-35	0,4 %	1,0 %
36-60	0,9 %	1,7 %
61-90	2,3 %	2,9 %
91-180	2,9 %	3,6 %
>180	3,3 %	3,5 %
Total	29,1 %	2,5 %

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	9	31	746	555	7	29	625	656	34	34	1072	970
Real	31	9	243	434	29	7	391	360	34	34	447	549
Total	40	40	989	989	36	36	1016	1016	68	68	1519	1519

* 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 15 de julio se presenta la proyección de vencimientos.