

Fecha de Publicación: 19 de Julio de 2005
 Fecha de Información: 15 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\$206,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|-------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 49,4 | 52,6 | 20,6 | 17,4 | 70,0 |
| 15-35 | 45,0 | 79,2 | 47,7 | 13,5 | 92,7 |
| 36-60 | 8,5 | 23,9 | 23,9 | 8,5 | 32,4 |
| 61-90 | 1,0 | 0,1 | 0,1 | 1,0 | 1,1 |
| 91-180 | 3,9 | 6,6 | 6,6 | 3,9 | 10,6 |
| >180 | - | 0,0 | 0,0 | - | 0,0 |
| Total | 107,8 | 162,4 | 98,9 | 44,3 | 206,7 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 10,0 % | 1,7 % |
| 15-35 | 1,0 % | 1,2 % |
| 36-60 | 0,8 % | 1,3 % |
| 61-90 | 1,3 % | 1,0 % |
| 91-180 | 2,8 % | 2,6 % |
| >180 | -0,1 % | -0,1 % |
| Total | 5,0 % | 1,4 % |

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 | | | | 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 | 32 | 769 | 585 | 8 | 29 | 651 | 678 | 34 | 34 | 1072 | 970 |
| Real | 32 | 9 | 261 | 445 | 29 | 8 | 393 | 367 | 34 | 34 | 447 | 549 |
| Total | 41 | 41 | 1030 | 1030 | 36 | 36 | 1044 | 1044 | 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 18 de julio se presenta la proyección de vencimientos.