

Fecha de Publicación: 21 de Julio de 2005
Fecha de Información: 18 de Julio de 2005¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$356,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,8	37,1	20,1	28,8	65,9
15-35	100,2	168,2	140,2	72,2	240,4
36-60	8,5	2,3	2,3	8,5	10,9
61-90	5,0	5,1	0,1	-	5,1
91-180	6,7	12,6	7,6	1,7	14,4
>180	20,0	20,0	0,0	-	20,0
Total	186,2	245,4	170,4	111,2	356,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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				1 al 5 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	9	32	795	586	7	29	673	712	3	61	346	251
Real	32	9	262	471	29	7	410	371	61	3	112	207
Total	41	41	1057	1057	36	36	1083	1083	64	64	458	458

* 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 19 de julio se presenta la proyección de vencimientos.