

Fecha de Publicación: 22 de Julio de 2005
 Fecha de Información: 19 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\$244,4 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	62,2	34,7	9,7	37,2	71,9
15-35	54,1	77,1	48,1	25,1	102,1
36-60	35,8	2,2	2,2	35,8	38,0
61-90	15,0	10,2	5,2	10,0	20,2
91-180	1,8	8,8	8,8	1,8	10,7
>180	-	1,4	1,4	-	1,4
Total	168,9	134,5	75,5	109,9	244,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,4 %	1,6 %
15-35	2,2 %	1,9 %
36-60	2,7 %	2,3 %
61-90	3,1 %	2,2 %
91-180	3,0 %	2,6 %
>180	4,2 %	4,0 %
Total	2,4 %	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	775	586	7	28	711	736	3	61	376	278
Real	32	9	262	451	28	7	419	394	61	3	114	212
Total	41	41	1037	1037	35	35	1130	1130	64	64	490	490

* 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 20 de julio se presenta la proyección de vencimientos.