

Fecha de Publicación: 25 de Julio de 2005
Fecha de Información: 21 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\$256,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	105,4	81,9	26,9	50,4	132,3
15-35	60,6	47,9	33,9	46,6	94,4
36-60	5,0	6,1	1,1	-	6,1
61-90	0,2	7,9	7,7	-	7,9
91-180	10,7	1,9	1,9	10,7	12,6
>180	-	2,9	2,9	-	2,9
Total	181,9	148,6	74,3	107,7	256,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	10	32	775	586	7	28	787	815	3	61	431	281
Real	32	10	262	451	28	7	446	418	61	3	114	265
Total	42	42	1037	1037	35	35	1233	1233	64	64	546	546

* 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 22 de julio se presenta la proyección de vencimientos.