

Fecha de Publicación: 28 de Julio de 2005
Fecha de Información: 26 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\$255,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	20,5	23,5	13,5	10,5	34,0
15-35	107,2	75,3	16,3	48,2	123,6
36-60	25,0	9,1	4,1	20,0	29,1
61-90	47,8	1,3	1,3	47,8	49,1
91-180	17,6	0,9	0,9	17,6	18,5
>180	-	1,1	1,1	-	1,1
Total	218,1	111,2	37,2	144,1	255,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	25 al 29 de Julio				1 al 5 de Agosto				8 al 12 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	9	28	866	916	5	61	486	307	3	95	460	334
Real	28	9	521	472	61	5	117	296	95	3	158	284
Total	36	36	1387	1387	66	66	603	603	98	98	618	618

* 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 27 de julio se presenta la proyección de vencimientos.