

Fecha de Publicación: 15 de Junio de 2005
Fecha de Información: 13 de Junio 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\$461,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	65,0	234,2	175,2	6,0	240,2
15-35	106,2	60,9	9,9	55,2	116,1
36-60	21,6	12,1	5,1	14,6	26,7
61-90	0,7	0,8	0,1	-	0,8
91-180	6,0	67,3	67,3	6,0	73,3
>180	2,0	2,2	2,2	2,0	4,2
Total	201,6	377,4	259,7	83,8	461,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,7 %	11,1 %
15-35	3,0 %	3,9 %
36-60	4,2 %	3,8 %
61-90	4,7 %	3,8 %
91-180	4,1 %	4,1 %
>180	3,9 %	3,9 %
Total	3,9 %	7,7 %

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	13 al 17 de Junio				20 al 24 de Junio				27 de Jun. al 1 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	41	44	807	1039	22	26	679	644	12	33	569	565
Real	41	39	639	407	25	20	285	320	33	12	289	292
Total	83	83	1446	1446	47	47	964	964	45	45	857	857

* 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 14 de junio se presenta la proyección de vencimientos.