

Fecha de Publicación: 16 de Junio de 2005
Fecha de Información: 14 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\$239,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	72,2	43,6	12,6	41,2	84,8
15-35	83,8	75,1	51,8	60,5	135,6
36-60	-	3,4	3,4	-	3,4
61-90	0,2	2,8	2,8	0,2	3,0
91-180	-	1,3	1,3	-	1,3
>180	10,4	10,9	0,9	0,3	11,2
Total	166,6	137,0	72,7	102,3	239,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,4 %	6,6 %
15-35	4,0 %	4,0 %
36-60	4,1 %	4,2 %
61-90	4,1 %	4,1 %
91-180	4,2 %	4,2 %
>180	4,1 %	4,1 %
Total	4,4 %	4,9 %

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	40	44	817	1040	22	26	734	674	12	33	577	582
Real	41	38	640	417	25	20	291	351	33	12	297	292
Total	82	82	1457	1457	47	47	1025	1025	45	45	874	874

* 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 15 de junio se presenta la proyección de vencimientos.