

Fecha de Publicación: 17 de Junio de 2005
Fecha de Información: 15 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\$160,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	70,4	41,8	2,3	30,9	72,7
15-35	34,6	39,1	13,1	8,6	47,7
36-60	5,0	4,1	1,6	2,5	6,6
61-90	11,4	17,1	6,1	0,4	17,5
91-180	11,0	14,5	3,5	-	14,5
>180	-	1,8	1,8	-	1,8
Total	132,5	118,4	28,4	42,5	160,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	95,6 %	7,7 %
15-35	3,5 %	3,7 %
36-60	3,9 %	3,9 %
61-90	3,9 %	3,9 %
91-180	4,1 %	4,1 %
>180	4,4 %	4,3 %
Total	22,7 %	5,6 %

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	21	27	797	714	12	36	586	585
Real	41	38	640	417	25	19	293	376	36	12	297	297
Total	82	82	1457	1457	46	46	1090	1090	48	48	883	883

* 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 16 de junio se presenta la proyección de vencimientos.