

Fecha de Publicación: 21 de Junio de 2005
Fecha de Información: 17 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\$209,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	42,1	16,0	2,0	28,1	44,2
15-35	75,9	72,1	36,1	39,9	112,0
36-60	12,0	0,9	0,9	12,0	12,9
61-90	8,8	19,6	11,6	0,8	20,4
91-180	4,0	15,4	11,4	-	15,4
>180	1,0	4,7	4,0	0,4	5,1
Total	143,8	128,7	66,1	81,2	209,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,7 %	4,3 %
15-35	4,4 %	4,3 %
36-60	4,1 %	2,4 %
61-90	4,1 %	4,0 %
91-180	4,4 %	4,3 %
>180	4,3 %	4,2 %
Total	5,3 %	4,1 %

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	1039	20	27	853	760	14	37	637	623
Real	41	38	640	418	25	18	309	402	36	14	321	336
Total	82	82	1457	1457	45	45	1163	1163	51	51	959	959

* 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 20 de junio se presenta la proyección de vencimientos.