

Fecha de Publicación: 22 de Junio de 2005
Fecha de Información: 20 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\$326,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	73,1	86,6	16,4	2,9	89,5
15-35	144,8	73,9	13,9	84,8	158,7
36-60	31,0	9,4	4,4	26,0	35,3
61-90	10,0	12,2	2,2	-	12,2
91-180	4,1	25,2	24,6	3,5	28,7
>180	-	1,7	1,7	-	1,7
Total	263,0	208,9	63,1	117,2	326,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8,2 %	11,5 %
15-35	3,8 %	4,3 %
36-60	3,8 %	4,2 %
61-90	4,6 %	4,7 %
91-180	4,4 %	3,9 %
>180	4,3 %	4,4 %
Total	5,0 %	6,2 %

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	20 al 24 de Junio				27 de Jun. al 1 de Julio				4 al 8 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	23	27	892	813	14	37	671	657	9	49	541	500
Real	25	21	324	403	37	13	322	336	49	9	224	265
Total	48	48	1216	1216	50	50	993	993	57	57	765	765

* 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 21 de junio se presenta la proyección de vencimientos.