

Fecha de Publicación: 23 de Junio de 2005
Fecha de Información: 21 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\$495,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	120,4	141,7	49,5	28,1	169,8
15-35	223,5	154,7	43,7	112,5	267,2
36-60	45,5	22,0	2,0	25,5	47,5
61-90	-	7,1	7,1	-	7,1
91-180	0,0	1,8	1,8	-	1,8
>180	-	2,1	2,1	-	2,1
Total	389,4	329,3	106,1	166,2	495,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	933	880	14	37	742	726	9	49	593	527
Real	25	21	372	424	37	14	324	340	49	9	230	296
Total	48	48	1304	1304	51	51	1066	1066	58	58	823	823

* 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 22 de junio se presenta la proyección de vencimientos.