

Fecha de Publicación: 24 de Junio de 2005
Fecha de Información: 22 de Junio de 2005 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$201,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13,9	27,7	25,7	11,9	39,5
15-35	139,8	78,7	10,2	71,3	150,1
36-60	0,1	0,3	0,3	0,1	0,4
61-90	0,5	1,3	1,2	0,4	1,6
91-180	0,1	3,0	2,9	-	3,0
>180	-	6,8	6,8	-	6,8
Total	154,3	117,7	47,1	83,7	201,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,9 %	2,3 %
15-35	3,4 %	3,4 %
36-60	4,1 %	3,9 %
61-90	4,2 %	4,3 %
91-180	4,0 %	4,5 %
>180	4,1 %	4,3 %
Total	3,8 %	3,2 %

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	933	880	16	38	745	732	9	49	624	563
Real	25	21	372	424	38	15	330	343	49	9	249	310
Total	48	48	1304	1304	53	53	1075	1075	58	58	873	873

* 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 23 de junio se presenta la proyección de vencimientos.