

Fecha de Publicación: 28 de Junio de 2005
 Fecha de Información: 24 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\$201,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,7	47,7	14,7	11,7	59,4
15-35	63,8	51,0	30,0	42,8	93,8
36-60	-	2,5	2,5	-	2,5
61-90	23,4	21,6	1,6	3,4	25,0
91-180	5,2	16,8	11,8	0,2	17,0
>180	-	3,6	3,6	-	3,6
Total	137,1	143,2	64,2	58,1	201,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	11,8 %	4,3 %
15-35	3,4 %	3,4 %
36-60	5,4 %	3,9 %
61-90	4,0 %	3,5 %
91-180	3,9 %	4,0 %
>180	4,3 %	4,1 %
Total	6,8 %	3,8 %

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	22	27	933	880	16	38	912	883	11	49	687	597
Real	25	20	372	424	38	16	361	390	49	11	270	361
Total	47	47	1304	1304	54	54	1273	1273	60	60	957	957

* 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 27 de junio se presenta la proyección de vencimientos.