

Fecha de Publicación: 29 de Junio de 2005
Fecha de Información: 27 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\$155,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	16,8	15,9	3,9	4,8	20,7
15-35	53,4	58,3	42,3	37,4	95,7
36-60	-	1,6	1,6	-	1,6
61-90	1,5	0,1	0,1	1,5	1,6
91-180	20,0	30,0	10,0	-	30,0
>180	-	5,5	5,5	-	5,5
Total	91,8	111,3	63,3	43,8	155,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	9,1 %	4,4 %
15-35	3,1 %	3,0 %
36-60	3,4 %	2,9 %
61-90	4,2 %	3,6 %
91-180	4,7 %	3,8 %
>180	4,2 %	4,2 %
Total	4,8 %	3,4 %

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	27 de Jun. al 1 de Julio				4 al 8 de Julio				11 al 15 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	16	38	914	888	11	49	696	602	13	34	694	614
Real	37	16	366	391	49	11	270	364	33	12	275	356
Total	54	54	1279	1279	60	60	966	966	47	47	969	969

* 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 28 de junio se presenta la proyección de vencimientos.