

Fecha de Publicación: 30 de Junio de 2005
Fecha de Información: 28 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\$215,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	47,9	59,6	29,6	17,9	77,5
15-35	87,3	45,2	20,2	62,3	107,5
36-60	15,3	2,2	2,2	15,3	17,5
61-90	4,3	-	-	4,3	4,3
91-180	5,6	2,2	2,2	5,6	7,8
>180	0,5	0,0	0,0	0,5	0,5
Total	160,9	109,1	54,1	105,9	215,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,3 %	4,9 %
15-35	3,9 %	4,1 %
36-60	3,4 %	4,5 %
61-90	3,5 %	3,5 %
91-180	3,2 %	3,5 %
>180	4,1 %	3,8 %
Total	4,8 %	4,4 %

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	37	911	889	11	49	728	653	14	34	743	632
Real	37	16	366	389	49	11	299	375	33	13	284	396
Total	53	53	1278	1278	60	60	1027	1027	47	47	1027	1027

* 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 29 de junio se presenta la proyección de vencimientos.