

Fecha de Publicación: 5 de Julio de 2005
 Fecha de Información: 30 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\$239,5 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	30,3	53,0	27,5	4,8	57,8
15-35	72,2	100,7	61,2	32,7	133,4
36-60	20,0	9,1	9,1	20,0	29,1
61-90	9,2	6,1	0,1	3,2	9,2
91-180	1,0	0,1	0,1	1,0	1,1
>180	6,0	8,9	2,9	-	8,9
Total	138,7	177,8	100,8	61,7	239,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,1 %	5,3 %
15-35	2,4 %	3,1 %
36-60	4,0 %	3,6 %
61-90	4,1 %	4,1 %
91-180	4,0 %	4,0 %
>180	4,3 %	4,2 %
Total	3,3 %	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	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	783	757	15	35	847	688
Real	37	15	366	389	49	11	376	403	33	14	303	462
Total	53	53	1278	1278	61	61	1159	1159	48	48	1150	1150

* 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 1 de julio se presenta la proyección de vencimientos.