

Fecha de Publicación: 06 de Julio de 2005
Fecha de Información: 01 de Julio 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\$188,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	35,8	30,6	15,1	20,3	50,9
15-35	34,8	64,8	55,8	25,8	90,6
36-60	8,8	7,5	2,5	3,8	11,3
61-90	3,8	1,2	1,2	3,8	5,0
91-180	-	0,1	0,1	-	0,1
>180	30,0	0,5	0,5	30,0	30,5
Total	113,3	104,7	75,2	83,8	188,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	12	48	792	760	18	35	871	715
Real	36	15	366	389	48	12	380	412	34	17	314	470
Total	52	52	1278	1278	59	59	1172	1172	51	51	1185	1185

* 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 4 de julio se presenta la proyección de vencimientos.