

Fecha de publicación: 2 de Junio de 2004
 Fecha de Información: 31 de Mayo de 2004 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\$68,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13,4	28,7	27,7	12,4	41,1
15-35	16,8	11,0	0,2	6,0	16,9
36-60	10,0	10,0	0,0	-	10,0
61-90	-	-	-	-	-
91-180	-	0,1	0,1	-	0,1
>180	-	-	-	-	-
Total	40,2	49,8	28,0	18,4	68,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,9 %	3,0 %
15-35	6,5 %	6,7 %
36-60	7,6 %	7,0 %
61-90	-	-
91-180	8,5 %	8,6 %
>180	-	-
Total	6,0 %	4,5 %

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	31 de May. al 4 de Junio				7 al 11 de Junio				14 al 18 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	34	69	554	487	31	33	347	294	21	20	251	205
Real	58	23	128	195	17	15	106	159	15	16	36	83
Total	92	92	682	682	48	48	453	453	37	37	288	288

* 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 1 de junio se presenta la proyección de vencimientos.