

Fecha de publicación: 3 de Junio de 2004
 Fecha de Información: 1 de Junio 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\$101,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 12,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	20,4	20,0	12,0	12,4	32,4
15-35	57,3	34,0	1,0	24,3	58,3
36-60	1,0	1,0	-	-	1,0
61-90	3,3	3,1	0,1	0,2	3,3
91-180	5,4	1,2	0,8	5,0	6,2
>180	-	-	-	-	-
Total	87,3	59,3	13,8	41,9	101,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	15,3 %	25,8 %
15-35	6,0 %	5,6 %
36-60	6,2 %	6,2 %
61-90	7,0 %	6,7 %
91-180	7,5 %	6,6 %
>180	-	-
Total	9,5 %	12,1 %

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	499	34	33	365	302	21	20	256	208
Real	58	23	140	195	17	18	106	169	15	16	37	85
Total	92	92	694	694	51	51	471	471	37	37	293	293

* 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 2 de junio se presenta la proyección de vencimientos.