

Fecha de publicación: 4 de Junio de 2004
 Fecha de Información: 2 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\$242,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	118,5	115,0	6,0	9,5	124,5
15-35	28,0	20,8	11,8	19,0	39,8
36-60	-	9,1	9,1	-	9,1
61-90	-	0,2	0,2	-	0,2
91-180	4,5	0,2	0,1	4,4	4,6
>180	14,1	54,0	50,0	10,1	64,1
Total	165,1	199,3	77,3	43,0	242,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,5 %	6,8 %
15-35	5,7 %	5,6 %
36-60	6,6 %	6,4 %
61-90	7,0 %	7,0 %
91-180	7,2 %	6,6 %
>180	7,2 %	8,1 %
Total	6,4 %	7,0 %

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	65	554	503	34	34	467	409	24	20	275	224
Real	54	23	144	195	18	18	111	169	15	19	42	93
Total	88	88	698	698	52	52	578	578	40	40	317	317

* 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 3 de junio se presenta la proyección de vencimientos.