

Fecha de publicación: 8 de Junio de 2004
 Fecha de Información: 4 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\$166,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	43,1	46,2	25,2	22,0	68,3
15-35	69,8	24,9	8,2	53,1	78,0
36-60	2,3	7,2	5,2	0,3	7,5
61-90	-	0,8	0,8	-	0,8
91-180	0,1	3,4	3,3	-	3,4
>180	2,9	5,5	5,5	2,9	8,3
Total	118,0	88,1	48,3	78,2	166,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,7 %	9,5 %
15-35	6,6 %	6,3 %
36-60	6,4 %	6,0 %
61-90	7,4 %	6,6 %
91-180	7,2 %	7,3 %
>180	6,7 %	7,2 %
Total	6,8 %	7,7 %

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	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	35	43	542	484	31	22	295	242
Real	54	23	144	195	27	20	113	172	17	26	61	114
Total	88	88	698	698	63	63	656	656	48	48	355	355

* 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 7 de junio se presenta la proyección de vencimientos.