

Fecha de publicación: 9 de Junio de 2004
 Fecha de Información: 7 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\$205,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	75,2	89,9	25,9	11,2	101,0
15-35	65,4	29,8	5,2	40,8	70,6
36-60	20,0	20,4	0,4	-	20,4
61-90	-	0,1	0,1	-	0,1
91-180	10,1	5,6	0,5	5,0	10,6
>180	-	2,7	2,7	-	2,7
Total	170,7	148,4	34,7	57,0	205,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,9 %	2,9 %
15-35	5,4 %	4,5 %
36-60	7,8 %	8,1 %
61-90	6,4 %	6,4 %
91-180	7,2 %	6,3 %
>180	7,2 %	7,1 %
Total	5,5 %	4,2 %

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	7 al 11 de Junio				14 al 18 de Junio				21 al 25 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	38	45	592	533	36	29	313	274	23	63	304	237
Real	27	20	113	173	19	26	85	124	50	10	39	106
Total	65	65	706	706	55	55	397	397	73	73	343	343

* 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 8 de junio se presenta la proyección de vencimientos.