

Fecha de publicación: 11 de Junio de 2004
Fecha de Información: 9 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\$89,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	15,2	32,1	18,6	1,7	33,8
15-35	43,3	32,6	4,0	14,7	47,3
36-60	-	0,0	0,0	-	0,0
61-90	5,0	5,0	-	-	5,0
91-180	0,0	2,8	2,8	0,0	2,8
>180	-	-	-	-	-
Total	63,6	72,5	25,4	16,5	89,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	10,6 %	6,3 %
15-35	5,0 %	4,4 %
36-60	5,1 %	5,1 %
61-90	8,4 %	8,4 %
91-180	7,1 %	6,5 %
>180	-	-
Total	7,4 %	5,4 %

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	613	545	51	57	335	330	25	64	320	251
Real	27	20	115	183	34	28	126	131	51	11	39	108
Total	65	65	728	728	85	85	461	461	76	76	359	359

* 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 10 de junio se presenta la proyección de vencimientos.