Fecha de publicación: 16 de Junio de 2004
Fecha de Información: 11 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$86,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,6%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	8,3	19,5	16,5	5,3	24,8
15-35	26,3	31,3	8,3	3,3	34,6
36-60	2,1	2,1	0,1	0,1	2,2
61-90	17,2	5,1	0,1	12,2	17,2
91-180	5,0	6,3	1,3	-	6,3
>180	1,0	1,0	-	-	1,0
Total	**59,9**	**65,2**	**26,2**	**20,9**	**86,1**

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,2 %	3,4 %
15-35	5,8 %	6,7 %
36-60	6,5 %	5,6 %
61-90	6,4 %	6,1 %
91-180	6,9 %	6,3 %
>180	7,0 %	7,0 %
Total	**5,0 %**	**5,6 %**

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	65	75	343	370	26	64	328	254
Real	27	20	115	183	39	29	163	136	51	12	39	113
Total	65	65	728	728	104	104	505	505	77	77	367	367

* 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 14 de junio se presenta la proyección de vencimientos.