

Fecha de publicación: 18 de Junio de 2004
Fecha de Información: 16 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\$119,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	10,8	18,2	12,9	5,5	23,7
15-35	51,1	48,7	2,2	4,6	53,3
36-60	3,8	5,7	2,2	0,3	6,0
61-90	5,4	14,1	14,1	5,4	19,5
91-180	2,4	2,8	2,8	2,4	5,1
>180	10,0	2,1	2,1	10,0	12,1
Total	83,3	91,6	36,3	28,0	119,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	14 al 18 de Junio				21 al 25 de Junio				28 de Jun. al 2 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	65	75	348	375	27	73	347	273	18	30	328	292
Real	39	29	163	136	59	14	41	115	24	12	100	137
Total	104	104	510	510	86	86	389	389	43	43	429	429

* 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 17 de junio se presenta la proyección de vencimientos.