

Fecha de publicación: 24 de Junio de 2004
Fecha de Información: 22 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\$112,7 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	34,5	49,5	30,5	15,5	65,0
15-35	21,0	16,0	0,0	5,0	21,0
36-60	1,4	4,5	4,2	1,0	5,5
61-90	-	0,0	0,0	-	0,0
91-180	20,6	0,5	0,5	20,6	21,1
>180	-	0,1	0,1	-	0,1
Total	77,4	70,7	35,3	42,1	112,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,8 %	4,0 %
15-35	6,4 %	6,5 %
36-60	7,0 %	7,8 %
61-90	7,0 %	7,1 %
91-180	6,9 %	6,1 %
>180	6,9 %	6,9 %
Total	6,3 %	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	21 al 25 de Junio				28 de Jun. al 2 de Julio				5 al 9 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	28	75	390	315	19	70	388	341	3	45	226	152
Real	61	15	50	125	64	13	110	157	44	2	30	103
Total	89	89	441	441	83	83	498	498	47	47	255	255

* 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 23 de junio se presenta la proyección de vencimientos.