

Fecha de publicación: 29 de Junio de 2004
Fecha de Información: 25 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\$166,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	69,5	24,6	9,5	54,4	79,0
15-35	19,9	9,7	1,5	11,7	21,4
36-60	0,0	1,3	1,3	-	1,3
61-90	10,3	10,7	1,7	1,3	12,0
91-180	34,6	23,0	8,4	20,0	43,0
>180	10,0	10,1	0,1	-	10,1
Total	144,3	79,4	22,5	87,4	166,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	12,7 %	2,8 %
15-35	6,2 %	5,5 %
36-60	6,4 %	6,0 %
61-90	6,6 %	6,5 %
91-180	6,9 %	6,3 %
>180	7,4 %	7,6 %
Total	7,7 %	4,6 %

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	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	72	81	470	419	3	45	248	156
Real	61	15	50	125	74	66	114	166	45	2	31	123
Total	89	89	441	441	147	147	585	585	48	48	279	279

* 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 28 de junio se presenta la proyección de vencimientos.