

Fecha de publicación: 7 de Mayo de 2004
 Fecha de Información: 5 de Mayo de 2004¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$163,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	40,1	19,5	2,0	22,6	42,1
15-35	102,7	55,9	13,9	60,7	116,6
36-60	-	1,5	1,5	-	1,5
61-90	0,0	2,4	2,4	-	2,4
91-180	-	0,8	0,8	-	0,8
>180	0,0	0,2	0,1	-	0,2
Total	142,9	80,3	20,7	83,3	163,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	12,7 %	11,7 %
15-35	5,5 %	6,2 %
36-60	6,9 %	6,9 %
61-90	6,3 %	5,2 %
91-180	6,5 %	6,0 %
>180	7,8 %	7,7 %
Total	7,4 %	7,6 %

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

Sector	3 al 7 de Mayo				10 al 14 de Mayo				17 al 21 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	31	40	587	500	25	34	350	261	28	51	534	464
Real	34	25	132	219	28	20	71	160	43	19	139	208
Total	65	65	719	719	53	53	421	421	71	71	672	672

* 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 6 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.