

Fecha de publicación: 12 de Mayo de 2004
Fecha de Información: 10 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\$93,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	18,3	17,1	0,9	2,1	19,2
15-35	41,4	44,0	9,8	7,1	51,1
36-60	4,6	2,1	2,1	4,6	6,7
61-90	0,2	0,7	0,7	0,2	0,9
91-180	12,5	13,8	1,3	-	13,8
>180	0,9	1,0	1,0	0,9	1,9
Total	77,9	78,8	15,9	14,9	93,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,2 %	7,7 %
15-35	7,8 %	8,3 %
36-60	6,3 %	4,7 %
61-90	8,3 %	8,1 %
91-180	11,3 %	7,7 %
>180	6,0 %	6,4 %
Total	7,3 %	7,8 %

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	10 al 14 de Mayo				17 al 21 de Mayo				24 al 28 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	30	86	387	310	34	52	650	597	8	26	258	249
Real	81	25	86	164	44	26	161	214	24	6	67	76
Total	111	111	473	473	78	78	811	811	32	32	325	325

* 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 11 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.