

Fecha de publicación: 13 de Mayo de 2004
 Fecha de Información: 11 de Mayo 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\$142,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	12,8	29,9	24,9	7,8	37,7
15-35	75,3	28,0	7,9	55,2	83,2
36-60	3,5	6,8	3,3	-	6,8
61-90	0,3	1,1	0,8	-	1,1
91-180	0,3	0,8	0,7	0,3	1,0
>180	11,8	11,0	1,0	1,8	12,8
Total	103,9	77,5	38,7	65,1	142,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	9,6 %	13,8 %
15-35	6,5 %	5,9 %
36-60	7,6 %	8,0 %
61-90	6,7 %	6,7 %
91-180	7,7 %	7,2 %
>180	7,5 %	7,6 %
Total	7,3 %	8,2 %

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	388	312	36	53	661	618	9	32	264	251
Real	81	25	88	164	44	27	176	219	31	8	69	81
Total	111	111	476	476	80	80	837	837	40	40	332	332

* 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 12 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.