

Fecha de publicación: 14 de Mayo de 2004
 Fecha de Información: 12 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\$85,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13,2	14,2	4,0	3,0	17,2
15-35	42,5	13,1	1,3	30,7	43,7
36-60	2,3	1,8	1,5	2,0	3,8
61-90	0,1	0,7	0,7	0,1	0,8
91-180	5,0	19,1	14,1	-	19,1
>180	-	0,7	0,7	-	0,7
Total	63,0	49,6	22,3	35,7	85,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	671	629	9	34	272	255
Real	81	25	88	164	44	27	178	220	33	8	70	87
Total	111	111	476	476	80	80	849	849	42	42	341	341

* 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 13 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.