

Fecha de publicación: 17 de Mayo de 2004
 Fecha de Información: 13 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\$89,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	31,4	35,7	6,7	2,4	38,1
15-35	19,6	28,5	11,0	2,1	30,6
36-60	0,7	0,4	0,3	0,5	0,9
61-90	2,2	2,7	0,7	0,2	2,9
91-180	6,0	5,9	0,9	1,0	6,9
>180	5,0	10,0	5,0	-	10,0
Total	64,8	83,3	24,6	6,2	89,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

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	39	54	699	663	10	34	272	255
Real	81	25	88	164	44	29	185	220	33	8	70	87
Total	111	111	476	476	83	83	883	883	43	43	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 14 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.