

Fecha de publicación: 18 de Mayo de 2004
 Fecha de Información: 14 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\$88,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13,7	9,4	5,4	9,7	19,2
15-35	21,9	7,6	0,9	15,2	22,9
36-60	20,1	26,0	5,9	0,0	26,0
61-90	12,7	3,6	1,4	10,4	14,0
91-180	2,0	4,6	2,5	-	4,6
>180	0,6	1,5	1,0	0,1	1,6
Total	71,2	52,7	17,1	35,5	88,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,6 %	14,3 %
15-35	5,2 %	1,6 %
36-60	5,4 %	6,7 %
61-90	7,6 %	6,6 %
91-180	8,3 %	7,9 %
>180	7,5 %	7,1 %
Total	6,2 %	7,1 %

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	39	84	705	638	11	35	278	259
Real	81	25	88	164	74	29	159	226	33	9	70	90
Total	111	111	476	476	113	113	864	864	44	44	348	348

* 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 17 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.