

Fecha de publicación: 19 de Mayo de 2004
 Fecha de Información: 17 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\$89,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	16,2	18,7	8,2	5,7	24,4
15-35	43,9	33,2	0,2	10,9	44,1
36-60	9,0	9,0	0,0	-	9,0
61-90	-	1,3	1,3	-	1,3
91-180	3,2	6,2	3,0	-	6,2
>180	3,1	4,0	1,0	0,1	4,1
Total	75,4	72,5	13,8	16,7	89,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	9,1 %	-2,7 %
15-35	7,3 %	8,7 %
36-60	8,3 %	7,9 %
61-90	9,1 %	8,8 %
91-180	10,7 %	8,2 %
>180	5,7 %	7,5 %
Total	8,6 %	5,4 %

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	17 al 21 de Mayo				24 al 28 de Mayo				31 de May. al 4 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	40	84	715	654	12	38	284	261	19	62	334	281
Real	74	30	165	226	36	9	70	93	57	14	78	131
Total	114	114	880	880	47	47	354	354	76	76	412	412

* 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 18 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.