

Fecha de publicación: 20 de Mayo de 2004
 Fecha de Información: 18 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\$83,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	9,1	13,3	5,3	1,1	14,4
15-35	33,0	32,3	9,8	10,5	42,8
36-60	14,3	13,6	-	0,7	14,3
61-90	0,3	1,3	1,0	-	1,3
91-180	10,5	3,5	0,5	7,5	11,0
>180	0,1	-	-	0,1	0,1
Total	67,2	64,0	16,6	19,8	83,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8,1 %	-3,7 %
15-35	5,5 %	5,4 %
36-60	6,7 %	6,3 %
61-90	8,8 %	8,3 %
91-180	7,7 %	6,7 %
>180	0,2 %	0,2 %
Total	6,6 %	4,2 %

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	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	85	718	661	12	38	284	261	20	62	344	295
Real	75	30	170	226	36	10	70	93	57	14	88	136
Total	115	115	888	888	48	48	354	354	77	77	432	432

* 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 19 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.