

Fecha de publicación: 26 de Mayo de 2004
 Fecha de Información: 21 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\$89,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	42,7	33,5	7,5	16,7	50,2
15-35	21,3	15,5	0,1	5,9	21,4
36-60	3,1	1,6	0,6	2,1	3,7
61-90	5,0	4,1	0,1	1,0	5,1
91-180	7,0	9,0	2,0	-	9,0
>180	-	-	-	-	-
Total	79,0	63,8	10,4	25,6	89,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,9 %	7,6 %
15-35	5,6 %	5,7 %
36-60	8,4 %	7,8 %
61-90	6,4 %	5,5 %
91-180	7,1 %	7,0 %
>180	-	-
Total	5,7 %	7,0 %

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	15	46	337	315	25	63	401	345
Real	75	30	170	226	44	13	108	129	58	20	91	148
Total	115	115	888	888	59	59	444	444	83	83	492	492

* 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 24 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.