

Fecha de publicación: 27 de Mayo de 2004
 Fecha de Información: 25 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\$176,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	48,4	46,0	12,1	14,6	60,5
15-35	66,9	71,7	9,7	4,9	76,6
36-60	14,0	13,8	2,8	3,0	16,8
61-90	0,2	2,9	2,7	-	2,9
91-180	0,4	9,3	8,9	-	9,3
>180	6,5	5,8	3,8	4,5	10,3
Total	136,4	149,4	40,0	27,0	176,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,4 %	6,2 %
15-35	7,8 %	8,6 %
36-60	7,0 %	7,3 %
61-90	7,3 %	7,4 %
91-180	7,2 %	6,9 %
>180	7,2 %	7,1 %
Total	7,4 %	7,4 %

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

Sector	24 al 28 de Mayo				31 de May. al 4 de Junio				7 al 11 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	16	46	345	330	26	63	439	370	29	31	310	256
Real	44	13	115	130	58	20	91	160	16	13	97	151
Total	59	59	460	460	83	83	530	530	45	45	407	407

* 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 26 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.