

Fecha de publicación: 28 de Mayo de 2004
 Fecha de Información: 26 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\$123,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	26,2	25,0	2,0	3,2	28,2
15-35	56,5	31,8	0,7	25,4	57,2
36-60	10,4	18,5	8,2	0,2	18,7
61-90	4,0	4,8	0,8	-	4,8
91-180	2,0	4,2	4,2	2,0	6,2
>180	8,7	0,7	-	8,0	8,7
Total	107,8	84,9	15,9	38,9	123,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	27	63	453	386	30	31	327	271
Real	44	13	115	130	58	22	93	160	16	14	97	154
Total	59	59	460	460	85	85	545	545	45	45	424	424

* 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 27 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.