

Fecha de publicación: 31 de Mayo de 2004
 Fecha de Información: 27 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\$151,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,1	17,6	2,6	23,1	40,7
15-35	48,6	65,7	30,1	13,0	78,7
36-60	15,4	16,4	1,0	-	16,4
61-90	0,3	1,1	0,8	-	1,1
91-180	1,3	6,4	5,4	0,2	6,6
>180	6,9	6,1	1,1	1,9	8,0
Total	110,6	113,3	40,8	38,2	151,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,0 %	-2,0 %
15-35	4,4 %	6,3 %
36-60	6,5 %	8,4 %
61-90	6,9 %	6,7 %
91-180	6,7 %	6,7 %
>180	7,5 %	7,5 %
Total	5,6 %	4,4 %

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	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	31	66	485	398	30	32	336	282
Real	44	13	115	130	58	23	93	180	16	14	105	158
Total	59	59	460	460	89	89	577	577	46	46	440	440

* 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 28 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.