

Fecha de publicación: 12 de Abril de 2004
 Fecha de Información: 6 de Abril 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\$169.5 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	24.0	33.4	9.4	-	33.4
15-35	59.8	45.5	7.5	21.8	67.3
36-60	0.4	1.0	1.0	0.4	1.4
61-90	26.3	1.7	1.6	26.3	27.9
91-180	27.0	10.8	5.8	22.0	32.8
>180	4.0	6.6	2.6	-	6.6
Total	141.4	99.1	28.0	70.4	169.5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4.4 %	4.5 %
15-35	3.2 %	3.5 %
36-60	5.1 %	5.4 %
61-90	5.6 %	4.1 %
91-180	6.8 %	5.8 %
>180	9.7 %	8.6 %
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	5 al 9 de Abril				12 al 16 de Abril				19 al 23 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	17	26	348	282	25	86	496	385	11	20	317	274
Real	22	13	42	108	75	13	91	202	19	10	95	139
Total	38	38	391	391	99	99	587	587	30	30	413	413

* 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 7 de abril se presenta la proyección de vencimientos.