

Fecha de publicación: 14 de Abril de 2004
 Fecha de Información: 12 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\$197.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	85.0	49.1	16.1	52.0	101.1
15-35	30.2	26.8	11.8	15.2	42.0
36-60	6.5	1.8	1.8	6.5	8.3
61-90	16.0	15.7	0.7	1.0	16.7
91-180	3.4	3.1	3.1	3.4	6.5
>180	17.4	10.0	5.0	12.4	22.4
Total	158.5	106.6	38.6	90.5	197.0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-4.9 %	-4.6 %
15-35	2.8 %	2.8 %
36-60	4.5 %	3.2 %
61-90	5.8 %	4.9 %
91-180	6.0 %	5.4 %
>180	7.2 %	7.2 %
Total	1.2 %	-0.2 %

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	12 al 16 de Abril				19 al 23 de Abril				26 al 30 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	26	86	567	412	11	29	341	306	10	35	137	145
Real	75	15	94	250	28	10	110	146	27	2	48	40
Total	101	101	661	661	39	39	452	452	37	37	184	184

* 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 13 de abril se presenta la proyección de vencimientos.