

Fecha de publicación: 15 de Abril de 2004
 Fecha de Información: 13 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\$136.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	40.0	24.6	2.1	17.5	42.1
15-35	47.5	56.0	17.5	9.0	65.0
36-60	10.0	0.9	0.9	10.0	10.9
61-90	1.3	0.8	0.6	1.0	1.8
91-180	8.0	7.0	5.0	6.0	13.0
>180	2.5	4.1	1.6	-	4.1
Total	109.3	93.4	27.6	43.5	136.9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	29.5 %	14.8 %
15-35	2.9 %	2.5 %
36-60	4.6 %	3.8 %
61-90	5.9 %	5.1 %
91-180	6.2 %	5.4 %
>180	6.8 %	6.7 %
Total	8.6 %	6.8 %

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	582	425	18	29	355	313	10	44	161	169
Real	75	15	94	252	28	16	113	155	36	2	53	45
Total	101	101	676	676	46	46	468	468	46	46	213	213

* 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 14 de abril se presenta la proyección de vencimientos.