

Fecha de publicación: 19 de Abril de 2004
 Fecha de Información: 15 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\$243.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	8.3	9.0	6.0	5.3	14.3
15-35	156.0	60.8	16.8	112.0	172.8
36-60	16.5	1.1	1.1	16.5	17.6
61-90	15.0	17.8	2.8	-	17.8
91-180	8.0	5.4	3.9	6.5	11.9
>180	0.5	9.3	9.0	0.2	9.5
Total	204.2	103.4	39.7	140.5	243.9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2.5 %	-2.5 %
15-35	3.1 %	2.6 %
36-60	4.0 %	3.8 %
61-90	5.3 %	4.7 %
91-180	6.2 %	5.2 %
>180	6.6 %	6.6 %
Total	4.3 %	2.8 %

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	20	38	366	325	10	45	181	183
Real	75	15	94	252	34	17	114	155	36	2	56	54
Total	101	101	676	676	55	55	480	480	47	47	237	237

* 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 16 de abril se presenta la proyección de vencimientos.