

Fecha de publicación: 20 de Abril de 2004
 Fecha de Información: 16 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\$153.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24.9	14.2	2.2	12.9	27.1
15-35	41.3	58.5	22.5	5.3	63.8
36-60	1.0	21.9	20.9	-	21.9
61-90	13.0	17.1	11.1	7.0	24.1
91-180	3.0	10.8	7.8	-	10.8
>180	6.1	6.1	0.1	0.1	6.2
Total	89.2	128.6	64.6	25.2	153.8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	15.8 %	1.8 %
15-35	2.8 %	2.8 %
36-60	3.5 %	3.6 %
61-90	4.8 %	4.6 %
91-180	6.3 %	5.9 %
>180	6.6 %	6.7 %
Total	6.2 %	3.4 %

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	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	21	38	376	327	11	46	194	194
Real	75	15	94	252	35	17	116	165	36	2	56	56
Total	101	101	676	676	55	55	492	492	48	48	250	250

* 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 19 de abril se presenta la proyección de vencimientos.