

Fecha de publicación: 22 de Abril de 2004
 Fecha de Información: 20 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\$154.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	20.1	7.9	0.2	12.4	20.2
15-35	53.3	47.7	6.2	11.8	59.5
36-60	23.1	21.5	2.5	4.1	25.5
61-90	33.5	38.6	8.6	3.5	42.1
91-180	-	0.8	0.8	-	0.8
>180	1.2	5.9	4.9	0.2	6.1
Total	131.1	122.3	23.1	31.9	154.2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2.6 %	-7.9 %
15-35	2.3 %	2.8 %
36-60	2.9 %	2.4 %
61-90	4.6 %	4.1 %
91-180	6.8 %	6.3 %
>180	6.4 %	6.5 %
Total	2.5 %	1.9 %

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	19 al 23 de Abril				26 al 30 de Abril				3 al 7 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	21	63	415	312	13	56	202	208	14	18	300	273
Real	60	17	91	194	46	3	62	57	15	11	80	107
Total	81	81	505	505	59	59	265	265	29	29	380	380

* 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 21 de abril se presenta la proyección de vencimientos.