

Fecha de publicación: 23 de Abril de 2004
 Fecha de Información: 21 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\$234.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	35.7	6.1	4.8	34.4	40.4
15-35	110.7	102.3	19.3	27.7	130.0
36-60	10.0	29.5	19.5	-	29.5
61-90	0.5	8.8	8.8	0.5	9.3
91-180	5.1	17.5	17.5	5.1	22.6
>180	1.1	2.7	1.7	0.1	2.8
Total	163.0	166.9	71.6	67.7	234.6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2.5 %	-6.3 %
15-35	2.1 %	1.8 %
36-60	4.0 %	4.0 %
61-90	3.5 %	3.3 %
91-180	5.3 %	4.8 %
>180	6.4 %	6.9 %
Total	1.5 %	1.1 %

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	15	61	234	209	15	28	310	281
Real	60	17	91	194	51	5	62	88	25	12	80	109
Total	81	81	505	505	66	66	297	297	40	40	390	390

* 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 22 de abril se presenta la proyección de vencimientos.