

Fecha de publicación: 27 de Abril de 2004
 Fecha de Información: 23 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\$143,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,42%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	25,6	41,3	21,8	6,1	47,5
15-35	36,2	78,5	45,9	3,6	82,1
36-60	8,0	9,0	1,0	-	9,0
61-90	-	0,9	0,9	-	0,9
91-180	-	3,1	3,1	-	3,1
>180	-	0,8	0,8	-	0,8
Total	69,8	133,6	73,5	9,8	143,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	10,9 %	11,4 %
15-35	3,9 %	3,9 %
36-60	4,9 %	2,9 %
61-90	5,6 %	5,7 %
91-180	6,4 %	6,4 %
>180	6,8 %	6,6 %
Total	6,5 %	6,4 %

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	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	18	63	257	244	15	28	348	289
Real	60	17	91	194	51	5	86	99	25	12	81	140
Total	81	81	505	505	68	68	344	344	40	40	429	429

* 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 26 de abril se presenta la proyección de vencimientos.