

Fecha de publicación: 30 de Abril de 2004
 Fecha de Información: 28 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\$161,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	64,2	27,1	10,5	47,6	74,7
15-35	55,9	20,4	2,3	37,8	58,3
36-60	4,0	2,0	0,0	2,0	4,0
61-90	5,0	7,1	2,1	-	7,1
91-180	6,1	6,3	1,3	1,1	7,4
>180	9,0	9,7	0,7	-	9,7
Total	144,2	72,6	16,9	88,5	161,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,0 %	3,8 %
15-35	3,2 %	4,0 %
36-60	2,1 %	1,9 %
61-90	5,4 %	5,0 %
91-180	5,9 %	6,0 %
>180	7,0 %	7,3 %
Total	2,7 %	4,2 %

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	26 al 30 de Abril				3 al 7 de Mayo				10 al 14 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	18	64	301	250	25	37	438	328	17	34	272	200
Real	51	5	87	137	34	22	91	201	28	12	47	120
Total	69	69	387	387	59	59	529	529	45	45	319	319

* 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 29 de abril se presenta la proyección de vencimientos.