

Fecha de publicación: 3 de Mayo de 2004
 Fecha de Información: 29 de Abril de 2004¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$135,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	67,8	68,0	10,0	9,8	77,8
15-35	46,1	27,8	4,2	22,5	50,3
36-60	0,1	-	-	0,1	0,1
61-90	2,8	1,0	0,5	2,3	3,3
91-180	0,6	2,2	2,2	0,6	2,8
>180	-	0,8	0,8	-	0,8
Total	117,4	99,9	17,8	35,3	135,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	28	39	499	393	17	34	288	205
Real	51	5	87	137	34	23	101	208	28	12	49	132
Total	69	69	387	387	62	62	600	600	46	46	337	337

* 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 30 de abril se presenta la proyección de vencimientos.