

Fecha de publicación: 4 de Mayo de 2004
 Fecha de Información: 30 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\$121,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 32,6 | 19,0 | 1,0 | 14,6 | 33,6 |
| 15-35 | 54,5 | 45,7 | 9,2 | 18,0 | 63,7 |
| 36-60 | 7,0 | 6,6 | 0,6 | 1,0 | 7,6 |
| 61-90 | - | 2,7 | 2,7 | - | 2,7 |
| 91-180 | - | 4,8 | 4,8 | - | 4,8 |
| >180 | 5,0 | 8,9 | 3,9 | - | 8,9 |
| Total | 99,1 | 87,7 | 22,2 | 33,6 | 121,3 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 1,0 % | 0,4 % |
| 15-35 | 3,6 % | 3,6 % |
| 36-60 | 5,9 % | 5,9 % |
| 61-90 | 6,7 % | 5,8 % |
| 91-180 | 6,6 % | 6,9 % |
| >180 | 12,3 % | 7,9 % |
| Total | 4,0 % | 3,3 % |

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

| Sector | 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 | 29 | 40 | 518 | 401 | 20 | 34 | 297 | 234 |
| Real | 51 | 5 | 87 | 137 | 34 | 23 | 102 | 219 | 28 | 15 | 69 | 133 |
| Total | 69 | 69 | 387 | 387 | 63 | 63 | 620 | 620 | 49 | 49 | 367 | 367 |

* 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 3 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.