

Fecha de publicación: 24 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 19 de Marzo 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\$175.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	26.4	12.3	12.3	26.4	38.6
15-35	69.7	41.4	0.4	28.7	70.1
36-60	1.3	20.0	19.0	0.3	20.3
61-90	2.0	8.4	6.4	-	8.4
91-180	7.0	15.8	12.0	3.2	19.0
>180	-	18.8	18.8	-	18.8
Total	106.3	116.8	69.0	58.5	175.2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4.6 %	5.1 %
15-35	5.6 %	6.0 %
36-60	5.9 %	5.9 %
61-90	6.7 %	6.5 %
91-180	6.8 %	6.9 %
>180	7.8 %	7.9 %
Total	5.8 %	6.1 %

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	15 al 19 de Marzo				22 al 26 de Marzo				29 de Mar. al 2 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	58	122	580	510	11	45	352	260	13	22	340	352
Real	117	53	130	200	40	6	36	128	15	6	97	85
Total	176	176	710	710	51	51	388	388	28	28	437	437

* 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 marzo se presenta la proyección de vencimientos.