

Fecha de publicación: 26 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 24 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\$209.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	60.9	97.0	37.0	0.9	97.9
15-35	66.8	47.9	10.1	29.0	76.9
36-60	5.3	5.0	-	0.3	5.3
61-90	10.0	3.7	0.7	7.0	10.7
91-180	17.0	12.0	-	5.0	17.0
>180	0.6	1.3	0.7	0.1	1.4
Total	160.5	166.8	48.5	42.3	209.0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4.4 %	10.1 %
15-35	6.5 %	7.1 %
36-60	8.0 %	8.0 %
61-90	6.2 %	6.2 %
91-180	6.8 %	6.8 %
>180	9.2 %	8.8 %
Total	6.1 %	8.5 %

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	22 al 26 de Marzo				29 de Mar. al 2 de Abril				5 al 9 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	11	45	352	261	53	74	389	490	6	14	269	216
Real	39	6	38	129	28	7	190	88	11	3	25	78
Total	50	50	390	390	80	80	578	578	17	17	294	294

* 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 25 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.