

Fecha de publicación: 31 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 29 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\$117.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45.4	47.5	13.0	10.9	58.3
15-35	52.7	50.9	1.9	3.7	54.6
36-60	1.0	1.0	-	-	1.0
61-90	-	0.0	0.0	-	0.0
91-180	3.1	3.8	0.7	-	3.8
>180	-	0.0	0.0	-	0.0
Total	102.2	103.2	15.6	14.6	117.8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5.5 %	6.0 %
15-35	5.8 %	5.7 %
36-60	5.7 %	5.7 %
61-90	7.6 %	7.6 %
91-180	5.5 %	7.1 %
>180	8.6 %	8.6 %
Total	5.7 %	5.9 %

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	29 de Mar. al 2 de Abril				5 al 9 de Abril				12 al 16 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	72	98	451	550	6	20	288	225	19	39	390	312
Real	37	11	207	109	17	3	25	88	28	8	78	156
Total	109	109	658	658	23	23	313	313	47	47	467	467

* 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 30 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.