

Fecha de publicación: 2 de Abril de 2004
 Fecha de Información: 31 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\$155.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	64.2	44.3	10.3	30.2	74.5
15-35	56.2	36.8	3.8	23.2	60.0
36-60	-	-	-	-	-
61-90	-	1.5	1.5	-	1.5
91-180	1.3	12.9	12.9	1.3	14.2
>180	-	5.4	5.4	-	5.4
Total	121.7	100.8	33.8	54.7	155.5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1.6 %	2.1 %
15-35	4.9 %	5.7 %
36-60	-	-
61-90	5.6 %	5.6 %
91-180	6.8 %	6.8 %
>180	4.8 %	7.4 %
Total	3.8 %	4.1 %

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	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	74	98	453	550	16	20	330	266	20	45	464	354
Real	37	13	207	111	17	13	30	94	34	9	83	193
Total	111	111	660	660	32	32	360	360	54	54	547	547

* 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 1 de abril se presenta la proyección de vencimientos.