

Fecha de publicación: 15 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 11 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\$52.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24.9	26.0	1.7	0.7	26.7
15-35	17.0	22.1	5.1	0.0	22.1
36-60	1.0	1.3	0.3	-	1.3
61-90	0.8	0.7	0.7	0.8	1.5
91-180	1.1	0.0	0.0	1.1	1.1
>180	-	0.0	0.0	-	0.0
Total	44.8	50.1	7.9	2.6	52.7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5.7 %	6.1 %
15-35	5.7 %	6.1 %
36-60	7.0 %	6.8 %
61-90	7.5 %	7.2 %
91-180	3.7 %	7.2 %
>180	0.1 %	0.1 %
Total	5.7 %	6.2 %

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	8 al 12 de Marzo				15 al 19 de Marzo				22 al 26 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	22	26	309	233	35	72	551	517	7	36	284	213
Real	24	19	60	135	68	31	164	199	31	2	32	103
Total	46	46	369	369	103	103	716	716	38	38	316	316

* 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 12 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.