

Fecha de publicación: 16 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 12 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\$60.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	10.8	23.1	12.6	0.3	23.4
15-35	19.7	15.8	0.1	4.0	19.8
36-60	-	1.3	1.3	-	1.3
61-90	-	1.9	1.9	-	1.9
91-180	2.0	0.8	0.8	2.0	2.8
>180	11.2	0.2	0.2	11.2	11.4
Total	43.7	43.2	17.0	17.5	60.7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8.4 %	9.4 %
15-35	7.5 %	10.3 %
36-60	6.9 %	6.0 %
61-90	7.3 %	7.5 %
91-180	7.3 %	6.3 %
>180	7.6 %	7.8 %
Total	7.6 %	9.1 %

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	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	81	557	525	7	36	288	219
Real	24	19	60	135	77	31	166	199	31	2	34	103
Total	46	46	369	369	112	112	723	723	38	38	322	322

* 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 15 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.