

Fecha de publicación: 18 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 16 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 4.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	16.2	15.7	1.7	2.2	18.0
15-35	68.2	55.0	3.0	16.2	71.2
36-60	11.0	11.6	0.6	-	11.6
61-90	3.7	3.8	3.3	3.2	7.0
91-180	0.0	9.1	9.1	-	9.1
>180	-	1.0	1.0	-	1.0
Total	99.1	96.2	18.7	21.6	117.8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2.2 %	-1.1 %
15-35	5.0 %	4.9 %
36-60	7.2 %	7.4 %
61-90	8.1 %	11.1 %
91-180	8.0 %	6.4 %
>180	7.1 %	8.0 %
Total	6.1 %	4.8 %

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	15 al 19 de Marzo				22 al 26 de Marzo				29 de Mar. al 2 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	58	160	580	472	7	37	309	240	10	22	273	282
Real	155	53	92	200	33	3	34	103	15	2	85	76
Total	214	214	672	672	40	40	343	343	25	25	358	358

* 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 17 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.