

Fecha de publicación: 18 de Marzo de 2005
 Fecha de Información: 16 de Marzo de 2005 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\$436,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	108,4	61,7	28,1	74,7	136,5
15-35	138,5	95,6	73,0	115,8	211,5
36-60	12,2	7,1	1,7	6,8	13,9
61-90	16,2	16,2	3,0	3,0	19,2
91-180	17,8	17,6	12,1	12,3	29,9
>180	20,7	19,7	4,9	5,9	25,6
Total	313,8	218,0	122,7	218,6	436,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,1 %	-6,4 %
15-35	5,5 %	4,9 %
36-60	3,4 %	4,6 %
61-90	4,2 %	4,6 %
91-180	4,3 %	4,9 %
>180	4,3 %	4,2 %
Total	3,3 %	1,3 %

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	14 al 18 de Marzo				21 al 25 de Marzo				28 de Mar. al 1 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	47	170	825	714	12	30	320	310	26	153	953	906
Real	159	35	314	426	30	11	77	87	151	24	423	470
Total	206	206	1140	1140	41	41	397	397	177	177	1376	1376

* 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 17 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.