

Fecha de publicación: 5 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 3 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\$57.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.8	1.0	1.0	0.8	1.8
15-35	27.5	23.6	0.1	4.0	27.6
36-60	-	1.0	1.0	-	1.0
61-90	-	0.4	0.4	-	0.4
91-180	16.2	4.7	3.7	15.2	19.9
>180	5.5	7.3	1.8	-	7.3
Total	50.1	37.9	7.9	20.1	57.9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7.9 %	4.5 %
15-35	6.4 %	7.6 %
36-60	5.5 %	5.5 %
61-90	7.4 %	7.4 %
91-180	7.5 %	7.0 %
>180	12.7 %	8.0 %
Total	8.3 %	7.3 %

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	1 al 5 de Marzo				8 al 12 de Marzo				15 al 19 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	16	33	253	182	22	24	301	225	25	62	440	396
Real	28	10	59	129	22	19	57	132	59	22	132	177
Total	43	43	311	311	43	43	358	358	84	84	572	572

* 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 4 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.