

Fecha de publicación: 8 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 4 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\$107.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	9.5	7.6	1.1	3.0	10.7
15-35	71.3	58.5	1.5	14.3	72.8
36-60	4.5	2.3	0.3	2.5	4.8
61-90	5.0	5.0	-	0.0	5.0
91-180	1.7	4.7	4.7	1.7	6.4
>180	7.4	7.1	0.1	0.4	7.5
Total	99.5	85.2	7.7	22.0	107.2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6.0 %	4.4 %
15-35	5.6 %	5.6 %
36-60	6.3 %	5.5 %
61-90	7.3 %	7.7 %
91-180	7.9 %	6.6 %
>180	10.0 %	8.4 %
Total	6.4 %	5.8 %

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	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	27	62	453	408
Real	28	10	59	129	22	19	57	132	59	23	133	178
Total	43	43	311	311	44	44	358	358	85	85	586	586

* 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 5 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.