

Fecha de publicación: 10 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 8 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\$87.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	18.9	35.3	35.3	18.9	54.2
15-35	19.0	17.0	-	2.0	19.0
36-60	1.8	0.2	0.2	1.8	2.0
61-90	1.0	1.0	-	-	1.0
91-180	3.1	0.0	0.0	3.1	3.1
>180	8.0	7.0	0.0	1.0	8.0
Total	51.7	60.6	35.6	26.7	87.3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7.5 %	9.1 %
15-35	6.7 %	6.5 %
36-60	7.1 %	7.0 %
61-90	6.8 %	6.8 %
91-180	7.5 %	6.9 %
>180	6.1 %	7.7 %
Total	7.1 %	8.3 %

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	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	304	228	27	68	483	449	6	36	267	201
Real	24	19	59	135	64	23	163	197	31	2	32	98
Total	46	46	363	363	91	91	646	646	37	37	299	299

* 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 9 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.