

Fecha de publicación: 11 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 9 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\$149.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	33.6	32.0	3.5	5.1	37.1
15-35	66.4	80.6	24.6	10.4	91.0
36-60	3.5	-	-	3.5	3.5
61-90	4.0	2.1	1.1	3.0	5.1
91-180	5.0	1.5	1.5	5.0	6.5
>180	5.6	5.9	0.4	0.1	6.0
Total	118.1	122.1	31.1	27.1	149.2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	10.4 %	9.1 %
15-35	6.2 %	6.5 %
36-60	5.0 %	5.1 %
61-90	7.2 %	6.8 %
91-180	7.8 %	7.1 %
>180	6.1 %	8.7 %
Total	7.7 %	7.2 %

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	309	233	30	70	508	474	6	36	272	202
Real	24	19	60	135	66	26	164	199	31	2	32	102
Total	46	46	369	369	96	96	672	672	37	37	304	304

* 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 10 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.