

Fecha de publicación: 12 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 10 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\$93.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	28.9	24.6	0.1	4.4	29.0
15-35	36.5	44.6	16.6	8.5	53.1
36-60	3.0	2.5	0.5	1.0	3.5
61-90	-	0.6	0.6	-	0.6
91-180	-	1.5	1.5	-	1.5
>180	5.0	5.4	0.4	-	5.4
Total	73.4	79.2	19.7	13.9	93.1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2.0 %	0.9 %
15-35	5.2 %	5.2 %
36-60	4.6 %	4.4 %
61-90	6.9 %	6.6 %
91-180	6.8 %	7.5 %
>180	17.1 %	9.3 %
Total	5.5 %	4.1 %

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	34	70	532	498	6	36	279	208
Real	24	19	60	135	66	31	164	199	31	2	32	103
Total	46	46	369	369	100	100	697	697	38	38	311	311

* 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 11 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.