Fecha de publicación: 4 de Febrero de 2004
Fecha de Información: 2 de Febrero 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$74.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4.7%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	27.4	27.0	3.0	3.4	30.4
15-35	20.0	26.7	8.7	2.0	28.7
36-60	3.0	7.0	7.0	3.0	10.0
61-90	-	0.0	0.0	-	0.0
91-180	-	0.6	0.6	-	0.6
>180	-	4.3	4.3	-	4.3
Total	**50.4**	**65.7**	**23.7**	**8.4**	**74.1**

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5.1 %	2.9 %
15-35	5.0 %	5.1 %
36-60	7.2 %	7.4 %
61-90	3.5 %	5.4 %
91-180	8.5 %	8.3 %
>180	8.2 %	8.1 %
Total	**6.2 %**	**4.7 %**

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	2 al 6 de Febrero				9 al 13 de Febrero				16 al 20 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	27	60	511	327	18	56	261	180	33	48	268	199
Real	45	12	83	267	47	10	105	186	34	19	80	149
Total	72	72	594	594	65	65	366	366	67	67	348	348

* Cifras en millones de dólares

[1] Datos provisionales.
[2] La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (Plazo/365)) - 1
[3] A partir del 3 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.