

Fecha de publicación: 20 de Febrero de 2004
 Fecha de Información: 18 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\$147.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	25.4	20.4	2.4	7.4	27.8
15-35	59.5	32.2	4.0	31.4	63.5
36-60	-	0.7	0.7	-	0.7
61-90	36.5	4.9	1.9	33.5	38.4
91-180	0.1	7.9	7.9	-	7.9
>180	-	8.7	8.7	-	8.7
Total	121.5	74.9	25.6	72.2	147.1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8.6 %	8.8 %
15-35	5.7 %	3.6 %
36-60	8.0 %	7.8 %
61-90	5.4 %	4.6 %
91-180	8.9 %	8.6 %
>180	8.1 %	7.9 %
Total	7.2 %	5.4 %

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	16 al 20 de Febrero				23 al 27 de Febrero				1 al 5 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	49	86	377	273	16	31	294	235	6	18	194	139
Real	64	27	100	204	28	13	93	151	17	5	30	84
Total	113	113	477	477	44	44	387	387	23	23	223	223

* 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 19 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.