

Fecha de publicación: 23 de Febrero de 2004
 Fecha de Información: 19 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\$90.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	12.5	1.0	0.0	11.5	12.5
15-35	48.8	29.8	1.8	20.8	50.5
36-60	-	0.7	0.7	-	0.7
61-90	2.3	3.9	1.9	0.3	4.2
91-180	0.1	3.1	3.0	-	3.1
>180	0.0	19.5	19.5	-	19.5
Total	63.6	57.9	26.9	32.5	90.5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8.3 %	-6.0 %
15-35	6.1 %	4.3 %
36-60	8.2 %	6.5 %
61-90	7.3 %	5.8 %
91-180	7.8 %	7.1 %
>180	6.9 %	8.2 %
Total	7.1 %	3.9 %

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	18	32	304	235	6	18	194	139
Real	64	27	100	204	28	14	93	161	17	5	30	84
Total	113	113	477	477	46	46	397	397	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 20 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.