

Fecha de publicación: 24 de Febrero de 2004
 Fecha de Información: 20 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\$171.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13.0	17.8	17.8	12.9	30.7
15-35	84.4	47.8	3.7	40.3	88.1
36-60	1.6	1.4	0.8	1.0	2.4
61-90	0.6	1.7	1.5	0.5	2.2
91-180	3.0	2.2	2.2	3.0	5.2
>180	-	43.4	43.4	-	43.4
Total	102.5	114.3	69.4	57.6	171.9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	16.4 %	11.8 %
15-35	5.5 %	6.6 %
36-60	5.4 %	5.1 %
61-90	6.9 %	7.0 %
91-180	7.6 %	8.1 %
>180	7.8 %	8.1 %
Total	8.2 %	7.9 %

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	19	48	316	238	6	18	194	139
Real	64	27	100	204	43	14	95	174	17	5	30	84
Total	113	113	477	477	62	62	411	411	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 23 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.