

Fecha de publicación: 25 de Febrero de 2004
 Fecha de Información: 23 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\$154.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.8	6.1	0.1	0.8	6.9
15-35	95.6	60.9	2.9	37.6	98.5
36-60	12.5	12.6	10.1	10.0	22.6
61-90	-	0.6	0.6	-	0.6
91-180	0.9	3.4	3.4	0.9	4.3
>180	15.1	6.9	6.9	15.1	22.0
Total	130.9	90.5	24.0	64.4	154.9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	11.5 %	6.2 %
15-35	6.5 %	5.7 %
36-60	7.7 %	9.7 %
61-90	7.5 %	7.8 %
91-180	7.4 %	7.4 %
>180	7.6 %	7.6 %
Total	7.5 %	6.6 %

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	23 al 27 de Febrero				1 al 5 de Marzo				8 al 12 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	19	48	316	238	7	18	200	145	19	24	218	168
Real	43	14	95	174	17	6	30	84	21	16	47	98
Total	62	62	411	411	24	24	229	229	40	40	265	265

* 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 24 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.