

Fecha de publicación: 26 de Febrero de 2004
 Fecha de Información: 24 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\$173.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	47.9	37.4	15.0	25.4	62.9
15-35	67.3	35.4	1.9	33.8	69.2
36-60	5.3	26.0	21.0	0.3	26.3
61-90	1.5	1.8	0.8	0.5	2.3
91-180	1.4	8.1	6.8	0.1	8.1
>180	0.3	4.2	4.2	0.3	4.5
Total	123.6	112.9	49.6	60.4	173.2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5.9 %	7.3 %
15-35	6.7 %	6.6 %
36-60	7.9 %	9.7 %
61-90	8.0 %	8.2 %
91-180	9.0 %	9.0 %
>180	8.5 %	9.8 %
Total	7.5 %	7.5 %

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	322	241	9	28	220	150	19	24	239	188
Real	43	14	95	177	27	8	35	104	21	16	49	100
Total	62	62	417	417	36	36	255	255	40	40	288	288

* 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 25 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.