

Fecha de publicación: 27 de Febrero de 2004
 Fecha de Información: 25 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\$92.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	10.6	11.6	3.6	2.6	14.2
15-35	38.1	44.5	8.5	2.1	46.6
36-60	6.0	5.5	0.5	1.0	6.5
61-90	2.4	2.0	0.5	0.9	2.9
91-180	2.6	15.4	15.2	2.4	17.8
>180	4.0	1.5	0.5	3.0	4.4
Total	63.6	80.5	28.8	11.9	92.4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	11.2 %	17.2 %
15-35	5.6 %	6.0 %
36-60	6.2 %	2.6 %
61-90	5.6 %	7.3 %
91-180	7.6 %	9.0 %
>180	7.4 %	7.6 %
Total	7.8 %	8.2 %

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	10	28	225	155	19	24	255	207
Real	43	14	95	177	27	9	35	104	22	17	52	100
Total	62	62	417	417	38	38	260	260	41	41	307	307

* 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 26 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.