

Fecha de publicación: 1 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 26 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\$205.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 11.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	39.8	37.5	22.0	24.3	61.8
15-35	87.5	60.8	5.1	31.8	92.5
36-60	6.2	6.5	0.5	0.2	6.7
61-90	4.1	0.6	0.1	3.6	4.1
91-180	1.2	39.0	39.0	1.2	40.2
>180	0.1	0.3	0.3	0.1	0.4
Total	138.8	144.7	67.0	61.1	205.7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	16.1 %	21.9 %
15-35	6.7 %	5.9 %
36-60	9.0 %	10.0 %
61-90	7.3 %	6.5 %
91-180	5.6 %	8.5 %
>180	8.2 %	7.8 %
Total	8.7 %	11.4 %

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	15	33	246	175	20	24	271	222
Real	43	14	95	177	27	9	55	125	22	17	55	104
Total	62	62	417	417	43	43	300	300	42	42	326	326

* 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 27 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.