

Fecha de publicación: 2 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 27 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\$98.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.8	7.3	5.1	4.6	12.0
15-35	43.6	26.7	12.7	29.6	56.3
36-60	0.3	0.4	0.4	0.3	0.7
61-90	5.1	2.8	2.8	5.1	7.9
91-180	15.0	3.9	3.9	15.0	18.9
>180	0.4	2.5	2.5	0.4	2.9
Total	71.2	43.6	27.4	55.0	98.6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6.0 %	14.1 %
15-35	7.9 %	7.5 %
36-60	4.5 %	5.4 %
61-90	7.0 %	6.6 %
91-180	7.6 %	6.4 %
>180	5.6 %	7.0 %
Total	6.9 %	8.0 %

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	16	33	250	179	20	24	273	225
Real	43	14	95	177	28	10	59	129	22	18	56	104
Total	62	62	417	417	43	43	308	308	42	42	329	329

* 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 1 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.