

Fecha de publicación: 10 de Febrero de 2004
 Fecha de Información: 6 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\$107.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	43.1	34.8	4.6	12.9	47.7
15-35	21.6	20.0	10.0	11.6	31.6
36-60	0.8	0.1	0.1	0.8	0.9
61-90	-	0.1	0.1	-	0.1
91-180	2.4	2.3	0.3	0.4	2.7
>180	24.0	-	-	24.0	24.0
Total	92.0	57.2	15.0	49.8	107.0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3.9 %	5.0 %
15-35	6.2 %	5.9 %
36-60	6.3 %	6.2 %
61-90	5.3 %	8.1 %
91-180	7.1 %	6.4 %
>180	7.0 %	7.1 %
Total	5.0 %	5.8 %

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	2 al 6 de Febrero				9 al 13 de Febrero				16 al 20 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	28	60	514	330	23	57	326	229	40	48	302	234
Real	45	13	83	267	49	15	110	207	34	26	95	164
Total	73	73	597	597	71	71	436	436	73	73	397	397

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (\text{Plazo}/365)) - 1$

³ A partir del 9 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.