

Fecha de publicación: 14 de Febrero de 2004
 Fecha de Información: 12 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\$137.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	42.3	26.0	5.0	21.3	47.3
15-35	27.3	14.5	9.0	21.8	36.3
36-60	5.0	11.0	6.0	0.0	11.0
61-90	5.0	0.2	0.2	5.0	5.2
91-180	31.7	12.0	0.8	20.5	32.5
>180	2.0	2.8	2.8	2.0	4.8
Total	113.3	66.4	23.7	70.6	137.1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6.1 %	6.9 %
15-35	6.7 %	6.7 %
36-60	7.7 %	8.5 %
61-90	5.0 %	6.8 %
91-180	7.9 %	7.6 %
>180	8.2 %	8.1 %
Total	6.9 %	7.2 %

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	9 al 13 de Febrero				16 al 20 de Febrero				23 al 27 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	23	57	337	255	49	56	353	272	14	31	234	201
Real	49	15	133	215	34	27	99	180	28	11	90	123
Total	71	71	469	469	83	83	452	452	42	42	324	324

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (Plazo/365)) - 1

³ A partir del 13 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.