

Fecha de publicación: 18 de Febrero de 2004
 Fecha de Información: 16 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\$61.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 0.2 | 0.0 | 0.0 | 0.2 | 0.2 |
| 15-35 | 33.3 | 17.0 | 0.5 | 16.8 | 33.8 |
| 36-60 | 20.0 | 15.2 | 0.2 | 5.0 | 20.2 |
| 61-90 | 5.0 | 1.2 | 1.2 | 5.0 | 6.2 |
| 91-180 | - | 0.4 | 0.4 | - | 0.4 |
| >180 | - | 1.0 | 1.0 | - | 1.0 |
| Total | 58.5 | 34.9 | 3.4 | 27.0 | 61.9 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 3.4 % | 1.0 % |
| 15-35 | 7.0 % | 6.6 % |
| 36-60 | 7.3 % | 6.6 % |
| 61-90 | 5.2 % | 6.5 % |
| 91-180 | 7.6 % | 8.1 % |
| >180 | 7.7 % | 7.7 % |
| Total | 6.7 % | 6.6 % |

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 | 16 al 20 de Febrero | | | | 23 al 27 de Febrero | | | | 1 al 5 de Marzo | | | |
|-------------------|---------------------|----|-----|-----|---------------------|----|-----|-----|-----------------|----|-----|-----|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Financiero | 49 | 56 | 377 | 273 | 15 | 31 | 239 | 208 | 5 | 18 | 180 | 127 |
| Real | 34 | 27 | 100 | 204 | 28 | 11 | 91 | 123 | 17 | 5 | 25 | 77 |
| Total | 83 | 83 | 477 | 477 | 43 | 43 | 331 | 331 | 23 | 23 | 204 | 204 |

* 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 17 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.