

Fecha de publicación: 19 de Febrero de 2004
 Fecha de Información: 17 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\$274.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 11.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 30.5 | 39.2 | 31.0 | 22.3 | 61.5 |
| 15-35 | 31.3 | 89.7 | 76.3 | 17.9 | 107.6 |
| 36-60 | 8.2 | 7.1 | 0.1 | 1.2 | 8.3 |
| 61-90 | 0.7 | 55.0 | 55.0 | 0.7 | 55.7 |
| 91-180 | 24.0 | 0.8 | 0.8 | 24.0 | 24.8 |
| >180 | - | 17.1 | 17.1 | - | 17.1 |
| Total | 94.7 | 208.9 | 180.3 | 66.1 | 274.9 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 10.6 % | 13.4 % |
| 15-35 | 7.6 % | 12.0 % |
| 36-60 | 6.9 % | 6.2 % |
| 61-90 | 8.6 % | 10.5 % |
| 91-180 | 6.0 % | 6.8 % |
| >180 | 8.1 % | 7.9 % |
| Total | 8.0 % | 11.1 % |

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 | 86 | 377 | 273 | 15 | 31 | 269 | 216 | 5 | 18 | 181 | 129 |
| Real | 64 | 27 | 100 | 204 | 28 | 12 | 91 | 145 | 17 | 5 | 26 | 78 |
| Total | 113 | 113 | 477 | 477 | 43 | 43 | 361 | 361 | 23 | 23 | 206 | 206 |

* 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 18 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.