

Fecha de publicación: 9 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 5 de Marzo 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\$92.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 14.3 | 15.4 | 4.4 | 3.3 | 18.7 |
| 15-35 | 44.4 | 33.7 | 2.7 | 13.4 | 47.1 |
| 36-60 | 13.5 | 9.7 | 0.7 | 4.5 | 14.2 |
| 61-90 | 2.0 | 2.4 | 0.4 | - | 2.4 |
| 91-180 | 9.0 | 9.1 | 0.1 | - | 9.1 |
| >180 | - | 1.0 | 1.0 | - | 1.0 |
| Total | 83.2 | 71.3 | 9.3 | 21.2 | 92.5 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 3.1 % | -1.3 % |
| 15-35 | 5.4 % | 5.0 % |
| 36-60 | 6.4 % | 6.0 % |
| 61-90 | 7.4 % | 6.9 % |
| 91-180 | 7.2 % | 6.9 % |
| >180 | 4.3 % | 8.3 % |
| Total | 5.2 % | 4.1 % |

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 | 1 al 5 de Marzo | | | | 8 al 12 de Marzo | | | | 15 al 19 de Marzo | | | |
|-------------------|-----------------|----|-----|-----|------------------|----|-----|-----|-------------------|----|-----|-----|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Financiero | 16 | 33 | 253 | 182 | 22 | 24 | 303 | 227 | 27 | 63 | 465 | 421 |
| Real | 28 | 10 | 59 | 129 | 22 | 19 | 59 | 134 | 59 | 23 | 135 | 179 |
| Total | 43 | 43 | 311 | 311 | 44 | 44 | 362 | 362 | 86 | 86 | 600 | 600 |

* 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 8 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.