

Fecha de publicación: 3 de Marzo de 2004
 Fecha de Información: 1 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\$112.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 28.3 | - | - | 28.3 | 28.3 |
| 15-35 | 48.3 | 40.1 | 5.9 | 14.1 | 54.2 |
| 36-60 | 8.0 | 8.0 | 0.0 | - | 8.0 |
| 61-90 | 12.0 | 13.0 | 1.0 | - | 13.0 |
| 91-180 | 3.6 | 4.0 | 4.0 | 3.6 | 7.5 |
| >180 | - | 1.9 | 1.9 | - | 1.9 |
| Total | 100.1 | 67.0 | 12.8 | 45.9 | 112.9 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 0.9 % | 1.9 % |
| 15-35 | 6.1 % | 6.0 % |
| 36-60 | 8.2 % | 4.8 % |
| 61-90 | 7.3 % | 7.7 % |
| 91-180 | 8.2 % | 7.3 % |
| >180 | 7.5 % | 7.9 % |
| Total | 6.3 % | 5.2 % |

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 | 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 | 250 | 179 | 21 | 24 | 301 | 225 | 25 | 62 | 430 | 390 |
| Real | 28 | 10 | 59 | 129 | 22 | 18 | 56 | 132 | 59 | 21 | 129 | 170 |
| Total | 43 | 43 | 308 | 308 | 42 | 42 | 357 | 357 | 84 | 84 | 560 | 560 |

* 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 2 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.