

Fecha de publicación: 8 de Enero de 2004
 Fecha de Información: 6 de Enero 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\$305.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|-------------|--------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 48.1 | 40.4 | 0.4 | 8.1 | 48.5 |
| 15-35 | 190.7 | 102.7 | 22.6 | 110.6 | 213.3 |
| 36-60 | 33.6 | 6.3 | 0.2 | 27.5 | 33.8 |
| 61-90 | 1.1 | 0.9 | 0.9 | 1.0 | 1.9 |
| 91-180 | 5.0 | 1.7 | 1.7 | 5.0 | 6.7 |
| >180 | 1.0 | 0.0 | 0.0 | 1.0 | 1.0 |
| Total | 279.4 | 151.9 | 25.7 | 153.2 | 305.1 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 5.5 % | 5.5 % |
| 15-35 | 8.8 % | 8.7 % |
| 36-60 | 9.2 % | 8.5 % |
| 61-90 | 10.3 % | 9.6 % |
| 91-180 | 9.7 % | 9.3 % |
| >180 | 10.5 % | 9.4 % |
| Total | 8.6 % | 8.2 % |

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 | 5 al 9 de Enero | | | | 12 al 16 de Enero | | | | 19 al 23 de Enero | | | |
|-------------------|-----------------|----|-----|-----|-------------------|----|-----|-----|-------------------|----|-----|-----|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Financiero | 17 | 51 | 628 | 395 | 23 | 24 | 397 | 291 | 19 | 32 | 201 | 144 |
| Real | 48 | 13 | 106 | 339 | 23 | 22 | 81 | 187 | 21 | 8 | 41 | 98 |
| Total | 64 | 64 | 733 | 733 | 47 | 47 | 478 | 478 | 40 | 40 | 242 | 242 |

* 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 7 de enero se presenta la proyección de vencimientos.