

Fecha de publicación: 7 de Enero de 2004
 Fecha de Información: 5 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\$182.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	62.0	53.0	-	9.0	62.0
15-35	110.0	45.8	1.0	65.2	111.0
36-60	2.0	2.3	0.3	-	2.3
61-90	2.5	2.6	0.1	-	2.6
91-180	3.0	0.2	0.2	3.0	3.2
>180	-	1.0	1.0	-	1.0
Total	179.5	104.9	2.6	77.2	182.1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	12.9 %	11.4 %
15-35	8.4 %	8.4 %
36-60	10.4 %	10.3 %
61-90	11.1 %	9.0 %
91-180	10.2 %	9.6 %
>180	9.5 %	9.5 %
Total	10.1 %	9.5 %

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	14	50	623	390	23	24	365	261	17	32	184	135
Real	47	12	106	339	23	22	81	185	21	6	41	90
Total	62	62	728	728	46	46	446	446	38	38	225	225

* 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 6 de enero se presenta la proyección de vencimientos.