

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.