

Fecha de publicación: 13 de Enero de 2004
 Fecha de Información: 8 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\$251.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	57.2	18.6	6.6	45.2	63.8
15-35	42.6	23.6	3.8	22.9	46.4
36-60	37.3	10.2	10.0	37.0	47.3
61-90	10.0	3.5	2.5	9.0	12.5
91-180	35.0	22.9	7.9	20.0	42.9
>180	25.0	28.6	13.6	10.0	38.6
Total	207.0	107.5	44.5	144.0	251.5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	10.3 %	19.7 %
15-35	6.9 %	7.1 %
36-60	7.6 %	6.8 %
61-90	8.8 %	7.3 %
91-180	8.5 %	7.5 %
>180	8.7 %	8.7 %
Total	8.4 %	10.6 %

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	27	27	457	325	20	33	225	159
Real	48	13	106	339	24	24	107	238	22	9	43	109
Total	64	64	733	733	50	50	563	563	42	42	268	268

* 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 9 de enero se presenta la proyección de vencimientos.