

Fecha de publicación: 14 de Enero de 2004
 Fecha de Información: 9 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\$139.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	34.3	30.4	4.4	8.3	38.6
15-35	25.2	21.1	17.1	21.2	42.3
36-60	30.1	1.4	1.4	30.1	31.4
61-90	-	2.3	2.3	-	2.3
91-180	8.6	9.2	9.2	8.6	17.8
>180	1.0	6.0	6.0	1.0	7.0
Total	99.1	70.3	40.3	69.1	139.4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	24.1 %	7.0 %
15-35	8.6 %	7.7 %
36-60	8.8 %	7.6 %
61-90	10.1 %	9.0 %
91-180	9.1 %	8.7 %
>180	8.4 %	8.4 %
Total	11.5 %	7.7 %

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	479	347	20	33	237	167
Real	48	13	106	339	24	24	110	242	23	9	43	113
Total	64	64	733	733	51	51	589	589	42	42	280	280

* 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 12 de enero se presenta la proyección de vencimientos.