

Fecha de publicación: 15 de Enero de 2004
 Fecha de Información: 13 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\$169.1 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	10.9	6.6	4.1	8.4	15.0
15-35	81.9	39.5	12.5	54.9	94.4
36-60	5.0	1.0	1.0	5.0	6.0
61-90	10.4	33.9	28.5	5.0	38.9
91-180	-	8.2	8.2	-	8.2
>180	6.5	6.6	0.1	-	6.6
Total	114.6	95.8	54.4	73.2	169.1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	11.2 %	7.3 %
15-35	8.8 %	8.0 %
36-60	8.0 %	5.3 %
61-90	9.0 %	9.7 %
91-180	9.5 %	8.8 %
>180	8.1 %	7.1 %
Total	9.4 %	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	12 al 16 de Enero				19 al 23 de Enero				26 al 30 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	28	26	479	348	24	35	242	172	22	44	182	198
Real	23	25	111	242	23	12	47	117	27	5	97	80
Total	51	51	590	590	47	47	289	289	49	49	279	279

* 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 14 de enero se presenta la proyección de vencimientos.