

Fecha de publicación: 16 de Enero de 2004
 Fecha de Información: 14 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\$220.3 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	43.0	13.0	4.0	34.0	47.0
15-35	52.6	20.0	2.0	34.6	54.6
36-60	55.5	12.3	0.8	44.0	56.3
61-90	18.0	27.6	10.6	1.0	28.6
91-180	29.0	0.7	0.7	29.0	29.7
>180	-	4.1	4.1	-	4.1
Total	198.1	77.7	22.2	142.6	220.3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5.5 %	10.0 %
15-35	7.1 %	6.6 %
36-60	6.3 %	6.1 %
61-90	8.9 %	9.8 %
91-180	7.8 %	7.1 %
>180	8.3 %	8.5 %
Total	6.9 %	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	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	27	36	274	182	22	44	191	202
Real	23	25	111	242	23	14	49	140	27	5	101	89
Total	51	51	590	590	50	50	322	322	49	49	291	291

* 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 15 de enero se presenta la proyección de vencimientos.