

Fecha de publicación: 19 de Enero de 2004
 Fecha de Información: 15 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\$175.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13.6	2.5	1.5	12.6	15.1
15-35	38.7	26.7	21.5	33.5	60.2
36-60	52.6	19.5	0.9	34.0	53.5
61-90	20.0	18.0	5.0	7.0	25.0
91-180	2.7	9.6	9.1	2.2	11.8
>180	-	10.1	10.1	-	10.1
Total	127.5	86.4	48.1	89.2	175.6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3.4 %	-2.5 %
15-35	6.2 %	5.7 %
36-60	6.4 %	6.3 %
61-90	6.7 %	6.3 %
91-180	7.0 %	7.0 %
>180	7.3 %	7.5 %
Total	5.9 %	5.4 %

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	36	38	275	182	23	51	196	203
Real	23	25	111	242	24	22	49	141	35	7	102	94
Total	51	51	590	590	60	60	324	324	58	58	297	297

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (\text{Plazo}/365)) - 1$

³ A partir del 16 de enero se presenta la proyección de vencimientos.