

Fecha de publicación: 21 de Enero de 2004
 Fecha de Información: 19 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\$40.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.4	7.0	4.0	3.4	10.4
15-35	26.8	14.6	0.0	12.3	26.8
36-60	2.0	0.1	0.1	2.0	2.1
61-90	0.5	0.7	0.1	-	0.7
91-180	-	0.4	0.4	-	0.4
>180	-	0.1	0.1	-	0.1
Total	35.7	22.9	4.8	17.6	40.5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0.2 %	5.8 %
15-35	6.6 %	7.1 %
36-60	6.4 %	3.7 %
61-90	7.7 %	7.0 %
91-180	8.8 %	8.5 %
>180	9.4 %	9.4 %
Total	5.6 %	6.6 %

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	19 al 23 de Enero				26 al 30 de Enero				2 al 6 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	37	38	283	191	25	52	233	247	15	53	388	215
Real	24	23	57	150	35	8	113	99	43	5	58	231
Total	61	61	340	340	59	59	346	346	58	58	446	446

* 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 20 de enero se presenta la proyección de vencimientos.