

Fecha de publicación: 22 de Enero de 2004
 Fecha de Información: 20 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\$167.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	26.9	17.9	4.0	13.1	31.0
15-35	67.1	58.2	6.2	15.1	73.3
36-60	10.0	18.3	8.3	-	18.3
61-90	-	2.7	2.7	-	2.7
91-180	0.3	10.0	9.9	0.2	10.2
>180	-	31.6	31.6	-	31.6
Total	104.3	138.7	62.7	28.4	167.1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	17.3 %	14.8 %
15-35	6.6 %	7.5 %
36-60	8.2 %	8.8 %
61-90	7.2 %	7.2 %
91-180	7.9 %	7.7 %
>180	9.0 %	9.4 %
Total	9.5 %	9.4 %

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	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	38	38	284	191	34	54	250	262	15	53	424	254
Real	24	24	57	151	35	15	116	104	43	5	63	233
Total	62	62	341	341	69	69	366	366	58	58	487	487

* 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 21 de enero se presenta la proyección de vencimientos.