

Fecha de publicación: 23 de Enero de 2004
 Fecha de Información: 21 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\$178.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	84.0	59.1	15.0	39.9	99.0
15-35	37.3	10.7	0.7	27.3	38.0
36-60	0.3	0.6	0.6	0.3	0.9
61-90	1.8	1.6	0.2	0.4	2.0
91-180	20.6	16.5	6.5	10.6	27.1
>180	0.3	10.9	10.9	0.3	11.2
Total	144.3	99.5	33.9	78.7	178.2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5.2 %	4.3 %
15-35	9.6 %	7.1 %
36-60	6.5 %	6.0 %
61-90	6.3 %	6.1 %
91-180	7.6 %	7.3 %
>180	8.2 %	8.1 %
Total	7.1 %	5.6 %

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	38	38	284	191	36	54	317	308	17	53	439	268
Real	24	24	57	151	35	17	131	140	43	7	63	234
Total	62	62	341	341	71	71	449	449	60	60	502	502

* 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 22 de enero se presenta la proyección de vencimientos.