

Fecha de publicación: 27 de Enero de 2004
 Fecha de Información: 23 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\$147.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	11.0	9.5	8.5	10.0	19.5
15-35	19.3	29.4	22.3	12.2	41.6
36-60	5.0	4.2	0.2	1.0	5.2
61-90	1.1	3.5	2.5	0.1	3.6
91-180	12.0	8.8	6.8	10.0	18.8
>180	45.0	13.8	13.8	45.0	58.8
Total	93.4	69.2	54.1	78.3	147.4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	15.1 %	9.1 %
15-35	4.5 %	2.5 %
36-60	7.1 %	4.6 %
61-90	8.4 %	7.3 %
91-180	8.0 %	7.1 %
>180	8.0 %	7.5 %
Total	9.0 %	6.2 %

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	38	54	338	326	18	53	451	283
Real	24	24	57	151	35	18	138	150	43	8	67	234
Total	62	62	341	341	73	73	476	476	61	61	517	517

* 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 26 de enero se presenta la proyección de vencimientos.