

Fecha de publicación: 29 de Enero de 2004
 Fecha de Información: 27 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\$64.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13.4	10.3	8.3	11.4	21.7
15-35	21.5	13.2	3.2	11.5	24.7
36-60	2.5	3.1	0.6	-	3.1
61-90	10.0	0.7	0.7	10.0	10.7
91-180	-	0.9	0.9	-	0.9
>180	-	3.0	3.0	-	3.0
Total	47.4	31.2	16.7	32.9	64.1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	12.8 %	7.8 %
15-35	8.0 %	7.6 %
36-60	7.6 %	6.2 %
61-90	7.3 %	5.1 %
91-180	7.5 %	7.2 %
>180	4.2 %	7.9 %
Total	9.2 %	7.2 %

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	26 al 30 de Enero				2 al 6 de Febrero				9 al 13 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	45	57	356	340	23	58	466	299	12	50	224	139
Real	35	23	143	159	45	11	73	239	47	9	89	175
Total	80	80	499	499	68	68	538	538	59	59	313	313

* 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 28 de enero se presenta la proyección de vencimientos.