

Fecha de publicación: 2 de Febrero de 2004
 Fecha de Información: 29 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\$102.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	9.3	8.9	7.0	7.4	16.3
15-35	24.0	41.2	21.4	4.2	45.4
36-60	6.4	1.9	1.9	6.4	8.3
61-90	11.2	5.8	2.8	8.2	14.0
91-180	2.0	17.4	15.4	0.0	17.4
>180	-	0.9	0.9	-	0.9
Total	52.9	76.1	49.5	26.2	102.3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6.5 %	3.5 %
15-35	7.1 %	7.4 %
36-60	6.6 %	6.6 %
61-90	7.6 %	6.3 %
91-180	8.2 %	8.1 %
>180	6.0 %	7.7 %
Total	7.2 %	6.7 %

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	40	57	361	340	25	58	491	307	12	51	244	163
Real	35	18	143	164	45	12	80	264	47	9	102	183
Total	75	75	504	504	70	70	571	571	60	60	346	346

* 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 30 de enero se presenta la proyección de vencimientos.