

Fecha de publicación: 3 de Febrero de 2004
 Fecha de Información: 30 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\$123.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24.3	24.1	3.1	3.3	27.3
15-35	24.4	16.3	1.3	9.4	25.7
36-60	-	0.0	0.0	-	0.0
61-90	1.7	2.4	1.2	0.5	2.9
91-180	2.0	18.7	16.7	-	18.7
>180	35.0	13.8	13.8	35.0	48.8
Total	87.4	75.3	36.1	48.2	123.5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1.6 %	4.2 %
15-35	4.5 %	3.0 %
36-60	7.0 %	7.0 %
61-90	6.8 %	6.9 %
91-180	7.7 %	7.2 %
>180	7.6 %	7.7 %
Total	5.5 %	5.8 %

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	501	317	12	51	258	177
Real	35	18	143	164	45	12	83	267	47	9	102	183
Total	75	75	504	504	70	70	584	584	60	60	360	360

* 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 2 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.