

Fecha de publicación: 4 de Diciembre de 2003
 Fecha de Información: 2 de Diciembre de 2003 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\$220.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	34.0	21.6	0.6	13.0	34.6
15 a 35	97.1	80.6	9.1	25.6	106.2
36 a 60	24.7	11.0	3.7	17.4	28.4
61 a 90	8.6	4.0	3.9	8.5	12.6
91 a 180	3.2	15.9	12.7	-	15.9
>180	0.1	22.7	22.6	-	22.7
Total	167.7	155.8	52.6	64.5	220.3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.2 %	10.7 %
15 a 35	9.9 %	9.9 %
36 a 60	9.3 %	9.0 %
61 a 90	9.7 %	9.7 %
91 a 180	9.7 %	9.7 %
>180	9.6 %	9.4 %
Total	9.6 %	9.8 %

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	1 al 5 de Diciembre				8 al 12 de Diciembre				15 al 19 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	59	38	465	359	14	29	444	301	29	41	330	240
Real	35	56	110	216	28	14	92	235	33	21	87	176
Total	94	94	575	575	42	42	537	537	62	62	416	416

* 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 3 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.