

Fecha de publicación: 10 de Diciembre de 2003
 Fecha de Información: 5 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\$73.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	15.4	6.3	3.1	12.2	18.5
15 a 35	18.0	13.4	6.3	11.0	24.4
36 a 60	-	2.8	2.8	-	2.8
61 a 90	6.7	11.1	4.4	-	11.1
91 a 180	1.1	5.1	4.1	0.1	5.3
>180	1.0	11.2	10.2	-	11.2
Total	42.3	49.8	30.9	23.3	73.1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.8 %	10.8 %
15 a 35	10.2 %	10.1 %
36 a 60	10.3 %	10.3 %
61 a 90	9.9 %	9.6 %
91 a 180	9.8 %	9.7 %
>180	9.4 %	8.1 %
Total	9.9 %	9.9 %

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	26	30	481	321	31	41	342	248
Real	35	56	110	216	29	25	112	272	34	23	87	182
Total	94	94	575	575	55	55	593	593	65	65	430	430

* 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 8 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.