

Fecha de publicación: 11 de Diciembre de 2003
 Fecha de Información: 9 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\$107.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	20.3	16.0	4.0	8.3	24.3
15-35	50.0	48.2	15.2	17.0	65.2
36-60	6.0	-	-	6.0	6.0
61-90	3.0	5.4	5.4	3.0	8.4
91-180	0.7	0.5	0.5	0.7	1.2
>180	2.5	2.5	0.0	-	2.5
Total	82.5	72.5	25.0	35.0	107.5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	9.2 %	10.2 %
15-35	10.7 %	10.9 %
36-60	8.2 %	8.3 %
61-90	10.0 %	10.6 %
91-180	10.6 %	10.5 %
>180	9.9 %	9.9 %
Total	10.0 %	10.5 %

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	8 al 12 de Diciembre				15 al 19 de Diciembre				22 al 26 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	26	30	481	321	36	41	352	257	13	24	254	310
Real	29	25	112	272	33	28	89	185	19	8	104	47
Total	55	55	593	593	69	69	442	442	32	32	357	357

* 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 10 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.