

Fecha de publicación: 12 de Diciembre de 2003
 Fecha de Información: 10 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\$190.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	59.1	15.0	1.8	45.9	60.9
15-35	63.5	17.5	5.5	51.5	68.9
36-60	29.0	13.3	3.3	19.0	32.3
61-90	2.3	2.2	1.9	2.0	4.2
91-180	0.4	2.2	1.8	-	2.2
>180	13.0	12.1	9.1	10.0	22.1
Total	167.2	62.2	23.3	128.3	190.6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	9.8 %	6.7 %
15-35	9.4 %	8.9 %
36-60	10.2 %	10.2 %
61-90	9.9 %	9.4 %
91-180	9.5 %	9.5 %
>180	9.5 %	9.4 %
Total	9.7 %	8.5 %

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	41	43	402	269	15	24	256	312
Real	29	25	112	272	35	33	90	223	19	10	104	47
Total	55	55	593	593	76	76	491	491	34	34	359	359

* 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 11 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.