

Fecha de publicación: 17 de diciembre de 2003
 Fecha de Información: 15 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\$93.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	12.4	5.4	5.4	12.4	17.8
15-35	33.9	27.4	4.1	10.6	38.0
36-60	10.0	5.0	2.0	7.0	12.0
61-90	0.0	1.5	1.5	-	1.5
91-180	0.2	3.4	3.2	-	3.4
>180	13.0	7.5	7.5	13.0	20.5
Total	69.5	50.2	23.7	43.0	93.2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	10.2 %	13.7 %
15-35	10.2 %	10.5 %
36-60	9.9 %	9.8 %
61-90	10.2 %	9.0 %
91-180	9.5 %	9.5 %
>180	9.5 %	9.5 %
Total	9.9 %	10.8 %

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	15 al 19 de Diciembre				22 al 26 de Diciembre				29 de Dic. al 2 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	52	44	443	284	17	24	264	321	11	11	283	407
Real	36	43	105	264	19	12	111	54	6	6	189	65
Total	88	88	548	548	36	36	376	376	17	17	472	472

* 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 16 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.