

Fecha de publicación: 18 de diciembre de 2003
 Fecha de información: 16 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\$134.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	63.6	10.1	0.1	53.6	63.7
15-35	37.6	28.4	4.3	13.6	41.9
36-60	-	4.3	4.3	-	4.3
61-90	-	5.9	5.9	-	5.9
91-180	4.0	15.9	11.9	-	15.9
>180	2.0	3.1	1.1	-	3.1
Total	107.3	67.5	27.5	67.2	134.7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5.5 %	5.5 %
15-35	10.1 %	9.7 %
36-60	10.6 %	11.0 %
61-90	10.2 %	9.7 %
91-180	10.1 %	9.9 %
>180	9.8 %	9.6 %
Total	9.6 %	7.8 %

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	63	44	465	289	17	24	279	326	12	11	298	407
Real	36	54	105	281	19	12	111	64	6	7	189	81
Total	98	98	570	570	36	36	391	391	18	18	487	487

* 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 17 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.