

Fecha de publicación: 24 de diciembre de 2003
 Fecha de Información: 22 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\$107.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	19.9	-	-	19.9	19.9
15-35	71.6	58.7	0.1	13.0	71.7
36-60	-	4.9	4.9	-	4.9
61-90	-	8.5	8.5	-	8.5
91-180	-	2.0	2.0	-	2.0
>180	-	-	-	-	-
Total	91.5	74.2	15.6	32.9	107.1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7.3 %	4.7 %
15-35	11.5 %	12.1 %
36-60	10.4 %	10.0 %
61-90	10.1 %	10.1 %
91-180	10.1 %	9.8 %
>180	-	-
Total	10.0 %	10.4 %

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	22 al 26 de Diciembre				29 de Dic. al 2 de Enero				5 al 9 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	38	25	296	329	23	11	324	424	11	47	539	318
Real	20	33	108	75	6	18	189	90	46	11	88	309
Total	57	57	404	404	29	29	514	514	57	57	627	627

* 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 23 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.