

Fecha de publicación: 26 de diciembre de 2003
 Fecha de Información: 23 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\$72.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	35.4	19.7	0.2	15.9	35.6
15-35	13.1	14.9	11.8	10.0	24.9
36-60	1.0	1.9	1.9	1.0	2.9
61-90	7.0	7.6	0.6	-	7.6
91-180	-	0.1	0.1	-	0.1
>180	1.1	0.1	0.1	1.1	1.2
Total	57.6	44.2	14.6	28.0	72.2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	10.8 %	11.4 %
15-35	9.6 %	10.1 %
36-60	10.5 %	9.5 %
61-90	10.0 %	9.3 %
91-180	10.4 %	10.3 %
>180	9.9 %	9.5 %
Total	10.3 %	10.6 %

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	44	22	335	429	13	49	541	320
Real	20	33	108	75	6	28	189	96	46	11	88	309
Total	57	57	404	404	50	50	525	525	59	59	629	629

* 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 24 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.