

Fecha de publicación: 30 de diciembre de 2003
 Fecha de Información: 29 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\$137.4 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	34.0	36.5	15.0	12.5	49.0
15-35	21.5	31.0	10.5	1.0	32.0
36-60	0.8	5.9	5.9	0.8	6.7
61-90	-	1.8	1.8	-	1.8
91-180	0.1	7.6	7.4	-	7.6
>180	-	40.3	40.3	-	40.3
Total	56.4	123.1	80.9	14.3	137.4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	9.3 %	12.0 %
15-35	9.6 %	10.7 %
36-60	9.7 %	9.4 %
61-90	8.5 %	9.5 %
91-180	9.5 %	9.7 %
>180	9.7 %	9.8 %
Total	9.5 %	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	29 de Dic. al 2 de Enero				5 al 9 de Enero				12 al 16 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	45	24	343	436	13	49	575	359	21	24	311	214
Real	8	28	190	97	47	11	104	320	23	20	81	179
Total	52	52	534	534	60	60	679	679	45	45	393	393

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) ^ (\text{Plazo}/365)) - 1$

³ A partir del 30 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.