

Fecha de publicación: 2 de Enero de 2004
 Fecha de Información: 30 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\$149.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	33.8	20.2	0.2	13.8	34.0
15-35	40.8	39.3	4.0	5.5	44.8
36-60	11.0	28.3	17.3	-	28.3
61-90	7.0	13.9	6.9	-	13.9
91-180	0.5	16.4	16.4	0.5	17.0
>180	-	11.4	11.4	-	11.4
Total	93.1	129.6	56.3	19.8	149.4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8.9 %	6.2 %
15-35	8.4 %	7.8 %
36-60	10.0 %	10.1 %
61-90	9.8 %	9.1 %
91-180	10.1 %	9.9 %
>180	9.8 %	10.0 %
Total	9.4 %	8.4 %

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	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	14	49	609	379	21	24	314	217
Real	8	28	190	97	47	11	104	333	23	20	81	179
Total	52	52	534	534	61	61	712	712	45	45	396	396

* 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 31 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.