

Fecha de publicación: 3 de Diciembre de 2003
 Fecha de Información: 1 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\$219.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	35.7	33.6	23.2	25.3	58.9
15 a 35	87.0	74.3	5.0	17.7	92.0
36 a 60	36.0	24.8	1.8	13.0	37.8
61 a 90	0.4	5.9	5.9	0.4	6.2
91 a 180	10.4	18.0	7.7	-	18.0
>180	0.1	6.1	6.0	-	6.1
Total	169.5	162.8	49.6	56.4	219.2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	12.2 %	13.4 %
15 a 35	8.6 %	8.5 %
36 a 60	9.8 %	10.1 %
61 a 90	9.8 %	9.6 %
91 a 180	9.8 %	10.5 %
>180	9.6 %	9.5 %
Total	9.9 %	10.3 %

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	1 al 5 de Diciembre				8 al 12 de Diciembre				15 al 19 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	59	38	465	359	11	28	428	285	29	41	298	230
Real	35	56	110	216	28	11	92	235	33	21	87	154
Total	94	94	575	575	39	39	521	521	61	61	384	384

* 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 2 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.