

Fecha de publicación: 26 de diciembre de 2003
 Fecha de Información: 24 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\$8.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.0	3.1	2.1	-	3.1
15-35	-	0.5	0.5	-	0.5
36-60	-	1.7	1.7	-	1.7
61-90	1.1	0.6	0.6	1.1	1.7
91-180	-	0.7	0.7	-	0.7
>180	-	0.5	0.5	-	0.5
Total	2.1	7.0	6.0	1.1	8.1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4.2 %	2.8 %
15-35	11.8 %	10.3 %
36-60	9.3 %	9.4 %
61-90	10.0 %	10.7 %
91-180	9.8 %	9.8 %
>180	10.0 %	9.8 %
Total	9.2 %	7.2 %

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	45	24	335	430	13	49	541	320
Real	20	33	108	75	7	28	190	96	46	11	88	309
Total	57	57	404	404	52	52	526	526	59	59	629	629

* 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 25 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.