

Fecha de publicación: 28 de Octubre de 2003
 Fecha de Información: 24 de Octubre 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\$211.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	32.1	26.0	6.0	12.1	38.1
15 a 35	89.2	41.2	11.2	59.2	100.4
36 a 60	1.4	4.5	4.5	1.4	5.9
61 a 90	2.0	7.1	5.1	-	7.1
91 a 180	-	2.8	2.8	-	2.8
>180	43.6	13.1	13.1	43.6	56.7
Total	168.2	94.8	42.7	116.2	211.0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	7.9 %	5.7 %
15 a 35	7.0 %	9.0 %
36 a 60	8.2 %	8.7 %
61 a 90	9.1 %	9.1 %
91 a 180	9.6 %	9.7 %
>180	9.4 %	9.5 %
Total	8.2 %	8.6 %

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	20 al 24 de Octubre				27 al 31 de Octubre				3 al 7 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	49	62	499	400	40	28	311	306	13	16	308	207
Real	46	33	174	274	15	27	117	121	15	11	45	146
Total	94	94	673	673	56	56	428	428	28	28	353	353

* 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 27 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.