

Fecha de publicación: 29 de Octubre de 2003
 Fecha de Información: 27 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\$97.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	44.2	36.1	4.1	12.2	48.4
15 a 35	29.1	11.4	4.0	21.7	33.1
36 a 60	15.4	2.4	0.4	13.4	15.8
61 a 90	0.3	0.2	0.2	0.3	0.5
91 a 180	-	0.2	0.2	-	0.2
>180	-	-	-	-	-
Total	89.0	50.2	8.8	47.6	97.9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.8 %	5.2 %
15 a 35	10.2 %	9.6 %
36 a 60	9.7 %	9.6 %
61 a 90	10.9 %	9.6 %
91 a 180	10.5 %	10.6 %
>180	-	-
Total	10.0 %	7.4 %

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	27 al 31 de Octubre				3 al 7 de Noviembre				10 al 14 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	42	28	326	325	22	16	326	223	27	53	312	193
Real	15	29	121	121	15	20	45	148	38	12	91	209
Total	57	57	446	446	36	36	371	371	65	65	402	402

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

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

³ A partir del 28 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.