

Fecha de publicación: 4 de Noviembre de 2003
 Fecha de Información: 30 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\$144.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	15.2	31.0	31.0	15.2	46.2
15 a 35	79.4	29.3	6.0	56.1	85.4
36 a 60	1.5	-	-	1.5	1.5
61 a 90	8.5	0.1	0.1	8.5	8.6
91 a 180	2.7	2.0	0.0	0.7	2.7
>180	-	-	-	-	-
Total	107.3	62.4	37.1	82.0	144.3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	13.1 %	14.0 %
15 a 35	10.0 %	8.7 %
36 a 60	8.5 %	8.5 %
61 a 90	9.5 %	9.3 %
91 a 180	8.5 %	8.8 %
>180	-	-
Total	10.5 %	10.4 %

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	43	28	335	333	41	17	326	282	33	64	331	215
Real	15	29	121	123	15	39	104	148	44	13	98	213
Total	58	58	456	456	56	56	430	430	77	77	429	429

* 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 octubre se presenta la proyección de vencimientos.