

Fecha de publicación: 6 de Noviembre de 2003
 Fecha de Información: 4 de Noviembre 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\$107.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	65.3	57.5	10.5	18.3	75.8
15 a 35	17.6	18.2	1.1	0.5	18.7
36 a 60	2.5	3.1	0.6	-	3.1
61 a 90	5.0	4.8	4.8	5.0	9.8
91 a 180	-	0.1	0.1	-	0.1
>180	-	-	-	-	-
Total	90.4	83.6	17.0	23.8	107.4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	10.4 %	10.2 %
15 a 35	9.3 %	10.0 %
36 a 60	9.5 %	10.2 %
61 a 90	9.2 %	9.2 %
91 a 180	9.6 %	9.6 %
>180	-	-
Total	9.8 %	10.1 %

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	3 al 7 de Noviembre				10 al 14 de Noviembre				17 al 21 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	43	17	354	310	54	64	378	272	11	20	210	83
Real	15	41	105	149	44	34	108	213	17	8	26	152
Total	58	58	459	459	98	98	486	486	28	28	236	236

* 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 5 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.