

Fecha de publicación: 7 de Noviembre de 2003
 Fecha de Información: 5 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\$150.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	5.0	3.2	0.9	2.7	5.9
15 a 35	76.7	62.2	24.0	38.5	100.7
36 a 60	17.0	18.2	1.2	-	18.2
61 a 90	1.2	12.7	11.5	-	12.7
91 a 180	0.3	6.5	6.3	-	6.5
>180	5.5	1.0	1.0	5.5	6.5
Total	105.7	103.7	44.8	46.7	150.5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.3 %	9.0 %
15 a 35	8.9 %	9.2 %
36 a 60	9.6 %	9.5 %
61 a 90	9.2 %	8.9 %
91 a 180	8.9 %	8.7 %
>180	9.3 %	9.3 %
Total	9.1 %	9.2 %

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	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	56	65	381	274	11	20	224	107
Real	15	41	105	149	45	36	108	214	17	8	46	162
Total	58	58	459	459	100	100	489	489	28	28	270	270

* 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 6 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.