

Fecha de publicación: 10 de Noviembre de 2003
 Fecha de Información: 6 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\$199.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	13.1	25.4	15.0	2.7	28.1
15 a 35	87.7	142.7	73.5	18.6	161.2
36 a 60	0.9	1.3	0.4	-	1.3
61 a 90	0.1	0.7	0.6	-	0.7
91 a 180	0.5	1.6	1.6	0.5	2.1
>180	6.4	-	-	6.4	6.4
Total	108.7	171.6	91.1	28.2	199.8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.5 %	12.2 %
15 a 35	9.7 %	10.6 %
36 a 60	9.2 %	9.1 %
61 a 90	9.6 %	9.7 %
91 a 180	9.8 %	9.9 %
>180	9.3 %	9.3 %
Total	9.4 %	10.7 %

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	57	65	383	286	11	20	237	141
Real	15	41	105	149	45	36	118	214	18	8	69	164
Total	58	58	459	459	101	101	501	501	28	28	306	306

* 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 7 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.