

Fecha de publicación: 11 de Noviembre de 2003
 Fecha de Información: 7 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\$165.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	56.0	11.5	2.9	47.4	58.9
15 a 35	56.2	65.5	33.3	24.0	89.5
36 a 60	0.2	0.7	0.7	0.2	0.9
61 a 90	0.2	3.5	3.5	0.2	3.6
91 a 180	0.1	4.0	3.9	-	4.0
>180	5.7	2.9	2.9	5.7	8.6
Total	118.4	88.1	47.1	77.4	165.5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	10.2 %	9.8 %
15 a 35	10.3 %	9.7 %
36 a 60	9.9 %	10.0 %
61 a 90	9.5 %	9.5 %
91 a 180	9.6 %	9.6 %
>180	9.6 %	9.2 %
Total	9.9 %	9.7 %

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	61	66	405	297	12	21	265	141
Real	15	41	105	149	45	40	120	229	18	9	69	192
Total	58	58	459	459	106	106	525	525	30	30	334	334

* 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 10 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.