

Fecha de publicación: 13 de Noviembre de 2003
Fecha de Información: 11 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\$151.6 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	40.0	8.5	0.5	32.0	40.6
15 a 35	70.0	61.5	13.5	22.0	83.5
36 a 60	2.0	2.1	0.1	-	2.1
61 a 90	1.8	5.4	3.6	-	5.4
91 a 180	0.5	0.3	0.3	0.5	0.7
>180	4.8	19.0	14.5	0.3	19.3
Total	119.1	96.9	32.6	54.8	151.6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.4 %	11.5 %
15 a 35	9.8 %	10.1 %
36 a 60	9.3 %	7.8 %
61 a 90	10.0 %	9.5 %
91 a 180	9.6 %	9.1 %
>180	9.4 %	9.6 %
Total	9.7 %	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	10 al 14 de Noviembre				17 al 21 de Noviembre				24 al 28 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	63	67	432	309	21	21	280	159	4	15	264	254
Real	45	42	121	244	18	18	71	192	14	4	115	125
Total	108	108	553	553	39	39	351	351	19	19	379	379

* 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 12 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.