

Fecha de publicación: 14 de Noviembre de 2003
 Fecha de Información: 12 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\$121.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3 a 14 | 12.9 | 2.0 | 2.0 | 12.9 | 14.9 |
| 15 a 35 | 68.9 | 24.6 | 2.3 | 46.6 | 71.2 |
| 36 a 60 | 25.6 | 0.3 | 0.3 | 25.6 | 25.9 |
| 61 a 90 | - | 3.6 | 3.6 | - | 3.6 |
| 91 a 180 | 0.7 | 4.1 | 4.1 | 0.7 | 4.9 |
| >180 | 0.1 | 1.1 | 1.1 | 0.1 | 1.2 |
| Total | 108.3 | 35.7 | 13.3 | 85.9 | 121.6 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3 a 14 | 6.9 % | 9.6 % |
| 15 a 35 | 9.6 % | 9.1 % |
| 36 a 60 | 9.2 % | 9.7 % |
| 61 a 90 | 9.9 % | 9.6 % |
| 91 a 180 | 9.7 % | 9.3 % |
| >180 | 9.8 % | 9.8 % |
| Total | 9.1 % | 9.3 % |

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 | 26 | 21 | 287 | 161 | 6 | 15 | 269 | 256 |
| Real | 45 | 42 | 121 | 244 | 18 | 23 | 73 | 200 | 14 | 5 | 117 | 130 |
| Total | 108 | 108 | 553 | 553 | 44 | 44 | 360 | 360 | 20 | 20 | 386 | 386 |

* 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 13 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.