

Fecha de publicación: 18 de Noviembre de 2003
 Fecha de Información: 13 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\$133.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	13.5	13.0	0.0	0.5	13.5
15 a 35	96.9	50.2	5.2	51.9	102.1
36 a 60	2.4	2.2	0.2	0.4	2.6
61 a 90	-	-	-	-	-
91 a 180	3.4	7.7	5.7	1.4	9.1
>180	-	6.2	6.2	-	6.2
Total	116.1	79.2	17.2	54.2	133.4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	10.1 %	9.6 %
15 a 35	9.9 %	8.9 %
36 a 60	9.7 %	9.5 %
61 a 90	-	-
91 a 180	9.6 %	9.6 %
>180	9.6 %	9.3 %
Total	9.8 %	9.0 %

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	286	269
Real	45	42	121	244	18	23	73	200	15	5	117	134
Total	108	108	553	553	44	44	360	360	20	20	403	403

* 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 14 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.