

Fecha de publicación: 19 de Noviembre de 2003
 Fecha de Información: 14 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\$104.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	21.7	21.2	10.2	10.7	31.9
15 a 35	60.6	30.6	4.3	34.3	64.9
36 a 60	0.1	0.2	0.1	-	0.2
61 a 90	0.2	0.4	0.2	-	0.4
91 a 180	-	5.2	5.2	-	5.2
>180	-	1.2	1.2	-	1.2
Total	82.7	58.9	21.3	45.0	104.0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	12.4 %	7.5 %
15 a 35	10.0 %	10.8 %
36 a 60	9.1 %	8.9 %
61 a 90	9.2 %	9.0 %
91 a 180	9.5 %	9.1 %
>180	9.5 %	9.5 %
Total	10.4 %	9.6 %

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	30	22	295	168	6	15	296	282
Real	45	42	121	244	19	27	79	207	15	5	120	134
Total	108	108	553	553	49	49	375	375	21	21	416	416

* 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 17 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.