

Fecha de publicación: 25 de Noviembre de 2003
 Fecha de Información: 21 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\$178.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|-------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3 a 14 | 23.2 | 13.8 | 3.8 | 13.2 | 27.1 |
| 15 a 35 | 79.3 | 49.0 | 26.5 | 56.8 | 105.8 |
| 36 a 60 | 5.0 | 1.9 | 1.9 | 5.0 | 6.9 |
| 61 a 90 | 2.0 | 2.4 | 0.4 | - | 2.4 |
| 91 a 180 | 0.0 | 3.8 | 3.8 | - | 3.8 |
| >180 | 16.4 | 31.9 | 15.5 | - | 31.9 |
| Total | 126.0 | 102.9 | 52.0 | 75.0 | 178.0 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3 a 14 | 1.1 % | 10.2 % |
| 15 a 35 | 9.5 % | 9.9 % |
| 36 a 60 | 9.9 % | 9.7 % |
| 61 a 90 | 9.9 % | 9.8 % |
| 91 a 180 | 9.6 % | 9.7 % |
| >180 | 10.0 % | 10.0 % |
| Total | 7.3 % | 9.9 % |

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 | 17 al 21 de Noviembre | | | | 24 al 28 de Noviembre | | | | 1 al 5 de Diciembre | | | |
|-------------------|-----------------------|----|-----|-----|-----------------------|----|-----|-----|---------------------|----|-----|-----|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Financiero | 33 | 22 | 300 | 169 | 15 | 20 | 391 | 330 | 58 | 13 | 376 | 303 |
| Real | 19 | 30 | 79 | 211 | 16 | 12 | 143 | 204 | 13 | 58 | 87 | 160 |
| Total | 52 | 52 | 380 | 380 | 32 | 32 | 534 | 534 | 71 | 71 | 463 | 463 |

* 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 24 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.