

Fecha de publicación: 27 de Noviembre de 2003
 Fecha de Información: 25 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\$189.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	41.6	25.5	7.0	23.1	48.6
15 a 35	56.8	47.0	1.0	10.8	57.8
36 a 60	55.3	21.1	0.1	34.3	55.4
61 a 90	7.5	4.4	4.4	7.5	11.9
91 a 180	4.0	9.6	5.6	-	9.6
>180	2.4	3.2	3.2	2.4	5.6
Total	167.7	110.8	21.3	78.2	189.0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	5.4 %	8.2 %
15 a 35	9.0 %	9.0 %
36 a 60	8.9 %	9.0 %
61 a 90	9.7 %	9.5 %
91 a 180	9.7 %	9.6 %
>180	9.5 %	9.6 %
Total	8.5 %	8.9 %

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	24 al 28 de Noviembre				1 al 5 de Diciembre				8 al 12 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	19	21	415	353	64	14	410	312	10	28	388	272
Real	16	14	162	224	14	64	87	185	28	10	86	202
Total	35	35	577	577	78	78	497	497	38	38	474	474

* 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 26 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.