

Fecha de publicación: 9 de Septiembre de 2003
 Fecha de Información: 5 de Septiembre 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\$140.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	40.7	31.2	1.1	10.6	41.8
15 a 35	76.0	17.5	5.7	64.2	81.7
36 a 60	0.1	1.9	1.9	0.1	2.0
61 a 90	-	1.2	1.2	-	1.2
91 a 180	-	4.3	4.3	-	4.3
>180	-	9.8	9.8	-	9.8
Total	116.8	65.9	24.0	74.9	140.8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	4.7 %	3.7 %
15 a 35	9.3 %	9.3 %
36 a 60	9.3 %	9.5 %
61 a 90	9.5 %	9.2 %
91 a 180	9.2 %	9.1 %
>180	9.3 %	9.2 %
Total	8.4 %	7.6 %

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

Sector	1 al 5 de Septiembre				8 al 12 de Septiembre				15 al 19 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	107	66	364	189	39	31	336	174	22	26	302	181
Real	16	57	39	213	26	34	59	221	21	16	34	156
Total	123	123	403	403	65	65	395	395	42	42	336	336

* 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 8 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.