

Fecha de publicación: 10 de Septiembre de 2003
 Fecha de Información: 8 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\$50.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	2.1	5.1	5.1	2.1	7.1
15 a 35	27.0	14.4	2.4	15.0	29.4
36 a 60	1.9	2.2	0.3	-	2.2
61 a 90	-	0.7	0.7	-	0.7
91 a 180	1.0	3.6	3.6	1.0	4.6
>180	6.0	0.6	0.6	6.0	6.6
Total	38.0	26.6	12.7	24.1	50.6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	1.7 %	-5.2 %
15 a 35	11.8 %	10.6 %
36 a 60	7.7 %	6.9 %
61 a 90	8.8 %	8.2 %
91 a 180	9.1 %	8.3 %
>180	8.8 %	8.8 %
Total	8.8 %	7.7 %

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	8 al 12 de Septiembre				15 al 19 de Septiembre				22 al 26 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	40	31	336	179	23	26	302	181	20	39	270	134
Real	26	34	64	221	21	17	34	156	29	10	40	177
Total	66	66	400	400	43	43	336	336	49	49	311	311

* 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 9 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.