

Fecha de publicación: 11 de Septiembre de 2003
 Fecha de Información: 9 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\$120.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	34.5	27.3	17.3	24.5	51.8
15 a 35	41.2	38.9	10.6	12.9	51.8
36 a 60	6.6	7.0	0.5	0.1	7.2
61 a 90	0.0	1.4	1.4	-	1.4
91 a 180	0.7	5.1	5.1	0.7	5.8
>180	2.0	0.7	0.7	2.0	2.7
Total	85.0	80.5	35.7	40.2	120.7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	13.8 %	7.1 %
15 a 35	8.9 %	8.8 %
36 a 60	7.5 %	7.8 %
61 a 90	8.9 %	8.6 %
91 a 180	9.0 %	8.7 %
>180	6.4 %	7.0 %
Total	10.0 %	8.0 %

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	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	41	31	336	179	24	26	329	203	20	39	281	140
Real	26	36	64	221	21	18	51	178	29	10	40	181
Total	67	67	400	400	44	44	380	380	49	49	321	321

* 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 10 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.