

Fecha de publicación: 1 de Septiembre de 2003
 Fecha de Información: 28 de Agosto 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\$141.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	18.3	25.6	10.1	2.8	28.4
15 a 35	59.5	26.6	0.3	33.2	59.8
36 a 60	5.0	13.0	8.0	-	13.0
61 a 90	0.3	8.2	8.2	0.3	8.4
91 a 180	-	13.6	13.6	-	13.6
>180	18.5	0.2	0.2	18.5	18.7
Total	101.5	87.2	40.4	54.7	141.9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	5.2 %	8.1 %
15 a 35	8.6 %	8.4 %
36 a 60	9.3 %	10.2 %
61 a 90	9.2 %	8.5 %
91 a 180	9.5 %	8.9 %
>180	9.3 %	8.9 %
Total	8.4 %	8.6 %

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

Sectores	25 al 29 de Agosto				1 al 5 de Septiembre				8 al 12 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	28	44	396	376	105	66	320	142	13	25	238	110
Real	41	24	171	191	16	55	29	208	24	12	46	175
Total	69	69	567	567	121	121	349	349	37	37	284	284

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (\text{Plazo}/365)) - 1$

³ A partir del 29 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.