

Fecha de publicación: 3 de Septiembre de 2003
 Fecha de Información: 1 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\$48.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 13.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	20.5	20.3	-	0.3	20.5
15 a 35	21.0	11.0	0.0	10.0	21.0
36 a 60	-	1.5	1.5	-	1.5
61 a 90	-	0.4	0.4	-	0.4
91 a 180	-	5.3	5.3	-	5.3
>180	-	0.1	0.1	-	0.1
Total	41.5	38.6	7.3	10.3	48.8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	10.6 %	17.8 %
15 a 35	9.8 %	9.6 %
36 a 60	9.8 %	9.6 %
61 a 90	10.0 %	10.0 %
91 a 180	9.6 %	9.4 %
>180	9.5 %	9.5 %
Total	10.0 %	13.0 %

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

Sectores	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	106	66	341	161	13	25	253	121	18	23	190	146
Real	16	56	33	213	24	12	47	180	19	14	34	78
Total	122	122	374	374	37	37	301	301	37	37	224	224

* 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 2 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.