

Fecha de publicación: 15 de Septiembre de 2003
 Fecha de Información: 11 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\$89.0 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	17.5	10.0	6.0	13.5	23.5
15 a 35	32.5	17.0	6.0	21.5	38.5
36 a 60	4.0	4.3	0.3	-	4.3
61 a 90	4.1	4.5	0.4	-	4.5
91 a 180	10.0	14.1	4.1	-	14.1
>180	4.0	-	-	4.0	4.0
Total	72.1	50.0	16.9	39.0	89.0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	6.8 %	7.4 %
15 a 35	9.0 %	9.3 %
36 a 60	8.9 %	8.5 %
61 a 90	9.0 %	8.6 %
91 a 180	9.1 %	8.8 %
>180	8.9 %	8.9 %
Total	8.3 %	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	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	27	26	354	213	22	40	301	146
Real	26	36	64	221	21	22	57	198	29	11	40	195
Total	67	67	400	400	48	48	411	411	51	51	341	341

* 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 12 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.