

Fecha de publicación: 17 de Septiembre de 2003
 Fecha de Información: 15 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\$92.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	50.8	43.4	-	7.4	50.8
15 a 35	38.5	11.5	0.0	27.0	38.5
36 a 60	-	0.2	0.2	-	0.2
61 a 90	-	0.0	0.0	-	0.0
91 a 180	-	0.1	0.1	-	0.1
>180	3.0	0.1	0.1	3.0	3.1
Total	92.3	55.4	0.5	37.4	92.8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	7.9 %	9.3 %
15 a 35	8.9 %	9.3 %
36 a 60	9.5 %	9.5 %
61 a 90	9.5 %	9.5 %
91 a 180	9.4 %	9.4 %
>180	7.1 %	3.3 %
Total	8.4 %	9.1 %

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	15 al 19 de Septiembre				22 al 26 de Septiembre				29 de Sep. al 3 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	29	26	381	249	23	40	355	183	44	20	306	193
Real	21	23	67	198	29	11	41	213	17	41	71	184
Total	50	50	447	447	52	52	396	396	61	61	378	378

* 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 16 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.