

Fecha de publicación: 18 de Septiembre de 2003
 Fecha de Información: 16 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\$75.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	13.7	9.7	0.0	4.0	13.7
15 a 35	39.6	22.4	3.2	20.3	42.7
36 a 60	3.8	3.3	-	0.5	3.8
61 a 90	1.5	1.5	0.3	0.3	1.8
91 a 180	0.7	0.4	0.4	0.7	1.1
>180	11.9	0.1	0.1	11.9	11.9
Total	71.1	37.4	3.9	37.6	75.0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	6.6 %	6.9 %
15 a 35	8.3 %	7.7 %
36 a 60	9.2 %	9.3 %
61 a 90	8.8 %	8.8 %
91 a 180	9.2 %	8.7 %
>180	9.2 %	9.0 %
Total	8.2 %	7.9 %

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	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	384	253	23	40	364	189	46	20	314	198
Real	21	24	67	198	29	12	41	216	17	43	71	187
Total	50	50	451	451	52	52	405	405	63	63	385	385

* 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 17 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.