

Fecha de publicación: 19 de Septiembre de 2003
 Fecha de Información: 17 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\$90.6 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	31.6	18.1	8.1	21.6	39.7
15 a 35	39.6	37.6	10.1	12.1	49.7
36 a 60	-	0.3	0.3	-	0.3
61 a 90	-	0.3	0.3	-	0.3
91 a 180	0.6	0.0	0.0	0.6	0.6
>180	-	0.0	0.0	-	0.0
Total	71.7	56.4	18.9	34.2	90.6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.4 %	9.4 %
15 a 35	9.0 %	9.0 %
36 a 60	9.9 %	10.0 %
61 a 90	9.3 %	9.1 %
91 a 180	9.7 %	8.8 %
>180	10.1 %	10.1 %
Total	9.0 %	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	384	253	23	40	395	207	56	30	314	206
Real	21	24	67	198	29	12	49	237	17	43	79	187
Total	50	50	451	451	52	52	444	444	73	73	393	393

* 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 18 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.