

Fecha de publicación: 22 de Septiembre de 2003
 Fecha de Información: 18 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\$334.3 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	79.0	17.1	2.0	63.8	81.0
15 a 35	118.4	184.5	120.2	54.1	238.6
36 a 60	1.2	2.7	2.1	0.6	3.3
61 a 90	4.3	3.4	3.4	4.3	7.6
91 a 180	1.5	-	-	1.5	1.5
>180	1.3	2.2	0.9	-	2.2
Total	205.7	209.9	128.6	124.3	334.3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.1 %	7.2 %
15 a 35	8.1 %	8.0 %
36 a 60	11.4 %	12.1 %
61 a 90	9.8 %	9.3 %
91 a 180	8.5 %	8.5 %
>180	8.9 %	8.4 %
Total	8.8 %	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	31	40	437	217	68	30	358	241
Real	21	24	67	198	29	20	49	268	17	54	86	203
Total	50	50	451	451	60	60	486	486	85	85	444	444

* 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 19 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.