

Fecha de publicación: 25 de Septiembre de 2003
 Fecha de Información: 23 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\$126.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	28.9	4.1	2.1	26.9	31.0
15 a 35	58.0	27.1	1.1	32.0	59.0
36 a 60	5.2	1.0	1.0	5.2	6.1
61 a 90	10.5	16.5	6.5	0.5	17.0
91 a 180	7.0	10.1	4.1	1.0	11.1
>180	-	2.5	2.5	-	2.5
Total	109.5	61.3	17.3	65.5	126.8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	3.3 %	3.0 %
15 a 35	7.2 %	8.9 %
36 a 60	8.2 %	9.1 %
61 a 90	9.3 %	9.5 %
91 a 180	9.2 %	9.3 %
>180	9.7 %	9.3 %
Total	7.1 %	7.6 %

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	22 al 26 de Septiembre				29 de Sep. al 3 de Octubre				6 al 10 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	46	46	445	240	85	31	381	259	37	48	276	275
Real	29	29	66	272	18	72	90	212	43	32	137	138
Total	75	75	512	512	103	103	471	471	80	80	414	414

* 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 24 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.