

Fecha de publicación: 26 de Septiembre de 2003
 Fecha de Información: 24 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\$81.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3 a 14 | 43.9 | 20.0 | 1.0 | 24.9 | 44.9 |
| 15 a 35 | 24.2 | 23.5 | 3.5 | 4.2 | 27.7 |
| 36 a 60 | 0.1 | 0.0 | 0.0 | 0.1 | 0.1 |
| 61 a 90 | 3.2 | 8.2 | 5.0 | - | 8.2 |
| 91 a 180 | - | 0.2 | 0.2 | - | 0.2 |
| >180 | - | - | - | - | - |
| Total | 71.4 | 52.0 | 9.8 | 29.2 | 81.2 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3 a 14 | 7.1 % | 6.8 % |
| 15 a 35 | 9.3 % | 10.0 % |
| 36 a 60 | 9.5 % | 9.1 % |
| 61 a 90 | 9.5 % | 9.3 % |
| 91 a 180 | 9.5 % | 9.5 % |
| >180 | - | - |
| Total | 8.5 % | 8.2 % |

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 | 86 | 31 | 401 | 273 | 37 | 50 | 302 | 284 |
| Real | 29 | 29 | 66 | 272 | 18 | 73 | 91 | 219 | 45 | 32 | 137 | 155 |
| Total | 75 | 75 | 512 | 512 | 104 | 104 | 492 | 492 | 82 | 82 | 440 | 440 |

* 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 25 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.