

Fecha de publicación: 1 de Octubre de 2003
 Fecha de Información: 29 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\$109.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	18.3	10.0	5.0	13.3	23.3
15 a 35	65.6	50.0	15.5	31.1	81.0
36 a 60	0.8	0.2	0.2	0.8	1.0
61 a 90	-	0.8	0.8	-	0.8
91 a 180	3.0	2.4	0.4	1.0	3.5
>180	-	0.1	0.1	-	0.1
Total	87.7	63.6	22.1	46.2	109.8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	7.6 %	5.0 %
15 a 35	8.6 %	9.0 %
36 a 60	9.6 %	9.2 %
61 a 90	9.9 %	9.7 %
91 a 180	9.8 %	8.8 %
>180	9.8 %	9.4 %
Total	8.7 %	8.1 %

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

Sectores	29 de Sep. al 3 de Octubre				6 al 10 de Octubre				13 al 17 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	99	33	433	303	41	52	365	326	16	23	206	129
Real	18	85	103	233	47	35	146	185	16	10	37	114
Total	118	118	536	536	88	88	512	512	33	33	243	243

* 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 30 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.