

Fecha de publicación: 7 de Octubre de 2003
 Fecha de Información: 3 de Octubre 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\$235.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	88.7	64.4	31.9	56.2	120.6
15 a 35	86.7	12.4	2.4	76.7	89.2
36 a 60	3.0	5.2	5.2	3.0	8.2
61 a 90	1.1	2.5	2.2	0.8	3.3
91 a 180	0.7	4.9	4.9	0.7	5.6
>180	0.8	8.0	7.3	-	8.0
Total	181.0	97.5	54.0	137.4	235.0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	4.9 %	3.7 %
15 a 35	8.5 %	11.0 %
36 a 60	8.7 %	10.4 %
61 a 90	9.1 %	8.7 %
91 a 180	9.4 %	9.2 %
>180	9.5 %	9.0 %
Total	7.8 %	7.1 %

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	102	35	436	306	72	152	433	381	20	24	320	201
Real	18	86	103	233	139	59	158	209	17	13	59	178
Total	121	121	539	539	211	211	591	591	37	37	379	379

* 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 6 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.