

Fecha de publicación: 8 de Octubre de 2003
 Fecha de Información: 6 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\$95.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	32.7	28.2	4.2	8.7	36.8
15 a 35	49.4	21.7	2.7	30.4	52.1
36 a 60	5.2	5.2	0.0	-	5.2
61 a 90	-	1.2	1.2	-	1.2
91 a 180	0.3	0.5	0.2	-	0.5
>180	-	0.0	0.0	-	0.0
Total	87.6	56.9	8.3	39.1	95.9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.6 %	4.4 %
15 a 35	9.1 %	9.3 %
36 a 60	10.2 %	10.7 %
61 a 90	9.6 %	9.6 %
91 a 180	9.8 %	9.5 %
>180	9.4 %	9.4 %
Total	9.1 %	7.5 %

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	6 al 10 de Octubre				13 al 17 de Octubre				20 al 24 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	75	154	444	392	20	24	333	216	19	39	293	237
Real	141	62	158	209	17	13	61	178	31	12	116	171
Total	216	216	602	602	37	37	394	394	51	51	408	408

* 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 7 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.