

Fecha de publicación: 10 de Octubre de 2003
 Fecha de Información: 8 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\$87.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3 a 14 | 27.4 | 23.4 | 1.0 | 5.0 | 28.4 |
| 15 a 35 | 56.3 | 5.7 | 0.0 | 50.6 | 56.3 |
| 36 a 60 | 0.2 | 0.1 | 0.1 | 0.2 | 0.3 |
| 61 a 90 | 0.7 | - | - | 0.7 | 0.7 |
| 91 a 180 | 0.7 | 0.7 | 0.0 | - | 0.7 |
| >180 | 1.0 | - | - | 1.0 | 1.0 |
| Total | 86.2 | 30.0 | 1.2 | 57.4 | 87.4 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3 a 14 | 6.7 % | 10.6 % |
| 15 a 35 | 8.7 % | 9.1 % |
| 36 a 60 | 9.6 % | 9.3 % |
| 61 a 90 | 6.2 % | 6.2 % |
| 91 a 180 | 9.5 % | 9.1 % |
| >180 | 8.9 % | 8.9 % |
| Total | 8.1 % | 9.6 % |

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 | 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 | 76 | 154 | 465 | 403 | 22 | 48 | 376 | 258 | 29 | 39 | 321 | 245 |
| Real | 141 | 63 | 160 | 221 | 41 | 15 | 61 | 180 | 32 | 21 | 117 | 194 |
| Total | 216 | 216 | 625 | 625 | 63 | 63 | 438 | 438 | 60 | 60 | 439 | 439 |

* 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 9 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.