

Fecha de publicación: 14 de Octubre de 2003
 Fecha de Información: 9 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\$83.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 11.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	29.0	24.2	3.6	8.3	32.5
15 a 35	45.8	22.3	0.8	24.3	46.5
36 a 60	-	0.1	0.1	-	0.1
61 a 90	0.5	0.3	0.3	0.5	0.8
91 a 180	1.5	2.9	1.4	-	2.9
>180	-	0.6	0.6	-	0.6
Total	76.8	50.3	6.6	33.1	83.4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	13.8 %	13.3 %
15 a 35	10.4 %	10.4 %
36 a 60	11.2 %	9.6 %
61 a 90	9.5 %	9.1 %
91 a 180	9.6 %	9.6 %
>180	9.9 %	9.9 %
Total	11.3 %	11.5 %

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	76	154	465	403	25	48	386	268	38	51	347	257
Real	141	63	160	221	41	19	61	180	35	22	117	207
Total	216	216	625	625	67	67	448	448	73	73	464	464

* 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 10 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.