

Fecha de publicación: 15 de Octubre de 2003
 Fecha de Información: 10 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\$127.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	46.6	29.8	9.5	26.3	56.1
15 a 35	56.3	25.4	11.4	42.3	67.7
36 a 60	-	0.5	0.5	-	0.5
61 a 90	-	2.5	2.5	-	2.5
91 a 180	-	0.4	0.4	-	0.4
>180	-	0.0	0.0	-	0.0
Total	102.9	58.6	24.3	68.6	127.2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.8 %	9.1 %
15 a 35	9.8 %	9.1 %
36 a 60	10.4 %	11.0 %
61 a 90	9.5 %	9.1 %
91 a 180	9.9 %	9.9 %
>180	9.5 %	9.5 %
Total	9.4 %	9.1 %

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	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	26	48	410	292	38	55	369	259
Real	141	63	160	221	42	19	65	184	39	22	119	229
Total	216	216	625	625	68	68	475	475	77	77	488	488

* 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 13 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.