

Fecha de publicación: 16 de Octubre de 2003
 Fecha de Información: 14 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\$73.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	10.7	9.5	3.4	4.7	14.1
15 a 35	20.6	8.2	-	12.4	20.6
36 a 60	0.6	0.8	0.2	-	0.8
61 a 90	1.2	9.5	8.3	-	9.5
91 a 180	14.9	19.4	9.4	4.9	24.2
>180	-	4.4	4.4	-	4.4
Total	48.0	51.8	25.7	21.9	73.7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	7.6 %	6.0 %
15 a 35	7.6 %	7.9 %
36 a 60	8.8 %	8.9 %
61 a 90	9.0 %	8.9 %
91 a 180	9.5 %	9.9 %
>180	9.5 %	9.3 %
Total	8.6 %	8.4 %

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	13 al 17 de Octubre				20 al 24 de Octubre				27 al 31 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	26	48	410	292	38	58	377	265	19	28	219	166
Real	42	19	65	184	42	23	119	231	15	6	51	104
Total	68	68	475	475	81	81	496	496	34	34	270	270

* 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 15 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.