

Fecha de publicación: 17 de Octubre de 2003
 Fecha de Información: 15 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\$134.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	51.4	44.4	17.4	24.4	68.8
15 a 35	37.2	14.6	0.6	23.2	37.8
36 a 60	1.2	1.3	0.2	0.1	1.3
61 a 90	9.8	18.3	15.0	6.5	24.8
91 a 180	-	1.3	1.3	-	1.3
>180	-	0.1	0.1	-	0.1
Total	99.5	80.0	34.6	54.1	134.1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	3.7 %	2.0 %
15 a 35	10.8 %	9.9 %
36 a 60	12.8 %	9.1 %
61 a 90	9.3 %	9.1 %
91 a 180	9.3 %	9.3 %
>180	9.6 %	9.6 %
Total	8.6 %	5.7 %

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	45	62	422	294	19	28	226	185
Real	42	19	65	184	46	29	121	249	15	6	63	104
Total	68	68	475	475	91	91	543	543	34	34	289	289

* 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 16 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.