

Fecha de publicación: 22 de Octubre de 2003
 Fecha de Información: 20 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\$164.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	59.7	83.1	51.1	27.7	110.8
15 a 35	46.3	16.5	0.5	30.3	46.8
36 a 60	0.1	0.4	0.4	-	0.4
61 a 90	-	1.8	1.8	-	1.8
91 a 180	0.4	0.7	0.7	0.4	1.0
>180	1.6	1.8	1.8	1.6	3.4
Total	108.1	104.4	56.3	60.0	164.3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	11.0 %	11.7 %
15 a 35	8.8 %	9.2 %
36 a 60	10.6 %	10.7 %
61 a 90	9.9 %	9.4 %
91 a 180	9.7 %	9.4 %
>180	9.4 %	9.5 %
Total	9.8 %	10.9 %

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	20 al 24 de Octubre				27 al 31 de Octubre				3 al 7 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	48	62	489	389	27	28	254	231	3	16	249	151
Real	46	32	174	274	15	14	82	104	14	2	37	134
Total	94	94	663	663	42	42	336	336	18	18	286	286

* 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 21 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.