

Fecha de publicación: 24 de Octubre de 2003
 Fecha de Información: 22 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\$159.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	15.4	12.4	2.3	5.3	17.7
15 a 35	66.2	25.5	7.5	48.2	73.7
36 a 60	1.0	1.7	1.7	1.0	2.6
61 a 90	0.2	5.6	5.6	0.2	5.7
91 a 180	-	2.3	2.3	-	2.3
>180	15.0	42.0	42.0	15.0	57.0
Total	97.7	89.4	61.3	69.6	159.0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	4.1 %	3.7 %
15 a 35	8.7 %	8.6 %
36 a 60	10.7 %	12.7 %
61 a 90	9.6 %	10.0 %
91 a 180	9.6 %	9.4 %
>180	9.8 %	9.8 %
Total	8.3 %	8.6 %

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

Sector	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	49	62	499	399	34	28	284	273	8	16	274	175
Real	46	33	174	274	15	21	94	105	14	6	44	142
Total	94	94	673	673	49	49	378	378	22	22	317	317

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Promedio SET FX}) ^ (\text{Plazo} / 365)) - 1$

³ A partir del 23 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.