

Fecha de publicación: 12 de Agosto 2003
 Fecha de Información: 8 de Agosto 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\$70.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	26.5	9.5	0.5	17.5	27.0
15 a 35	10.3	10.5	4.2	4.0	14.5
36 a 60	1.4	0.5	0.5	1.4	1.9
61 a 90	0.1	2.4	2.3	-	2.4
91 a 180	1.0	3.6	2.6	-	3.6
>180	-	21.1	21.1	-	21.1
Total	39.3	47.6	31.3	22.9	70.5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.9 %	2.9 %
15 a 35	8.9 %	8.5 %
36 a 60	8.3 %	8.4 %
61 a 90	7.1 %	8.6 %
91 a 180	9.5 %	9.3 %
>180	9.7 %	9.7 %
Total	8.9 %	6.8 %

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	4 al 8 de Agosto				11 al 15 de Agosto				18 al 22 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	40	19	351	322	54	93	537	491	4	24	228	152
Real	13	35	105	134	63	24	163	208	22	2	50	126
Total	53	53	456	456	117	117	699	699	26	26	278	278

* 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 11 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.