

Fecha de publicación: 5 de Agosto 2003
 Fecha de Información: 1 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\$90.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	34.6	19.3	3.0	18.3	37.6
15 a 35	38.5	22.0	11.5	28.0	50.0
36 a 60	2.0	0.0	0.0	2.0	2.0
61 a 90	-	0.0	0.0	-	0.0
91 a 180	1.0	0.0	0.0	1.0	1.1
>180	-	-	-	-	-
Total	76.1	41.4	14.6	49.3	90.7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	4.8 %	9.0 %
15 a 35	8.5 %	9.5 %
36 a 60	8.4 %	9.2 %
61 a 90	9.1 %	9.1 %
91 a 180	9.6 %	8.8 %
>180	-	-
Total	6.6 %	9.3 %

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	28 de Jul. al 1 de Agosto				4 al 8 de Agosto				11 al 15 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	31	20	384	371	40	19	351	322	51	89	411	394
Real	16	26	126	139	13	34	105	134	62	24	135	151
Total	47	47	510	510	53	53	456	456	113	113	545	545

* 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 4 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.