

Fecha de publicación: 6 de Agosto 2003
 Fecha de Información: 4 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\$128.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	52.6	44.2	16.2	24.6	68.8
15 a 35	46.6	35.6	8.6	19.6	55.2
36 a 60	0.1	2.1	2.1	0.1	2.2
61 a 90	-	-	-	-	-
91 a 180	-	2.2	2.2	-	2.2
>180	-	-	-	-	-
Total	99.3	84.1	29.1	44.3	128.4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.3 %	9.1 %
15 a 35	9.3 %	9.1 %
36 a 60	9.2 %	10.0 %
61 a 90	-	-
91 a 180	9.6 %	9.4 %
>180	-	-
Total	8.9 %	9.2 %

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	53	92	460	435	3	24	202	128
Real	13	35	105	134	62	24	151	175	22	1	50	123
Total	53	53	456	456	115	115	611	611	25	25	251	251

* 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 5 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.