

Fecha de publicación: 8 de Agosto 2003
 Fecha de Información: 5 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\$88.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	28.2	27.1	5.0	6.1	33.2
15 a 35	46.6	12.6	2.6	36.6	49.1
36 a 60	-	2.9	2.9	-	2.9
61 a 90	-	0.1	0.1	-	0.1
91 a 180	-	0.3	0.3	-	0.3
>180	2.6	0.0	0.0	2.6	2.6
Total	77.3	43.0	10.9	45.2	88.2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.3 %	10.3 %
15 a 35	8.4 %	8.8 %
36 a 60	10.2 %	10.2 %
61 a 90	9.7 %	9.7 %
91 a 180	9.6 %	9.5 %
>180	5.7 %	7.4 %
Total	8.7 %	9.4 %

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	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	485	460	4	24	208	132
Real	13	35	105	134	62	24	156	181	22	2	50	125
Total	53	53	456	456	116	116	641	641	26	26	257	257

* 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 6 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.