

Fecha de publicación: 11 de Agosto 2003
 Fecha de Información: 6 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\$86.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 11.3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	41.1	36.4	6.1	10.8	47.2
15 a 35	14.1	13.3	2.3	3.0	16.3
36 a 60	-	5.2	5.2	-	5.2
61 a 90	1.0	5.0	4.0	-	5.0
91 a 180	5.0	1.0	1.0	5.0	6.0
>180	-	6.6	6.6	-	6.6
Total	61.2	67.6	25.2	18.8	86.4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	12.4 %	13.0 %
15 a 35	9.8 %	11.0 %
36 a 60	8.4 %	10.9 %
61 a 90	10.2 %	10.8 %
91 a 180	9.7 %	9.1 %
>180	5.5 %	2.2 %
Total	10.1 %	11.3 %

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

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	54	92	513	485	4	24	225	149
Real	13	35	105	134	62	24	163	191	22	2	50	126
Total	53	53	456	456	116	116	676	676	26	26	275	275

* 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 7 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.