

Fecha de publicación: 13 de Agosto 2003  
 Fecha de Información: 11 de Agosto 2003 <sup>1</sup>

### INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$85.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.3%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	0.3	2.4	2.1	-	2.4
15 a 35	20.9	16.6	6.2	10.5	27.1
36 a 60	0.1	0.9	0.9	-	0.9
61 a 90	11.1	12.2	1.1	-	12.2
91 a 180	24.1	42.3	18.3	-	42.3
>180	0.2	0.3	0.1	-	0.3
<b>Total</b>	<b>56.6</b>	<b>74.7</b>	<b>28.6</b>	<b>10.5</b>	<b>85.2</b>

\* Cifras en millones de dólares

**Cuadro No. 2**  
**Devaluación Implícita Anualizada**

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	11.3 %	14.2 %
15 a 35	9.3 %	8.1 %
36 a 60	8.9 %	8.0 %
61 a 90	9.3 %	9.7 %
91 a 180	9.5 %	9.6 %
>180	8.7 %	8.6 %
<b>Total</b>	<b>9.5 %</b>	<b>9.3 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sector	11 al 15 de Agosto				18 al 22 de Agosto				25 al 29 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	54	93	537	491	4	24	228	154	19	37	243	297
<b>Real</b>	63	24	163	208	22	2	52	126	37	19	157	104
<b>Total</b>	117	117	699	699	26	26	280	280	56	56	400	400

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (Plazo/365)) - 1

<sup>3</sup> A partir del 12 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.