

Fecha de publicación: 14 de Agosto 2003
 Fecha de Información: 12 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\$131.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	41.7	30.2	1.2	12.7	42.9
15 a 35	38.5	23.4	3.4	18.5	41.9
36 a 60	10.3	20.1	9.8	-	20.1
61 a 90	8.6	18.7	10.4	0.3	19.0
91 a 180	0.3	6.5	6.5	0.3	6.8
>180	0.5	0.5	-	-	0.5
Total	99.8	99.5	31.4	31.7	131.1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	7.2 %	8.0 %
15 a 35	9.1 %	9.0 %
36 a 60	9.5 %	9.9 %
61 a 90	9.1 %	9.8 %
91 a 180	9.4 %	9.1 %
>180	8.3 %	8.3 %
Total	8.8 %	8.9 %

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	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
Financiero	54	93	537	492	4	24	254	171	20	37	273	314
Real	63	24	164	208	22	2	52	135	37	20	160	119
Total	117	117	700	700	26	26	306	306	57	57	433	433

* 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 13 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.