

Fecha de publicación: 15 de Agosto 2003  
 Fecha de Información: 13 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 10.5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	16.8	19.0	8.0	5.8	24.8
15 a 35	44.7	16.7	0.0	28.0	44.7
36 a 60	0.2	0.4	0.2	-	0.4
61 a 90	1.8	8.3	6.5	-	8.3
91 a 180	3.0	5.9	3.9	1.0	6.9
>180	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>66.5</b>	<b>50.3</b>	<b>18.6</b>	<b>34.8</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	11.0 %	11.6 %
15 a 35	9.8 %	10.3 %
36 a 60	9.6 %	9.5 %
61 a 90	9.4 %	9.7 %
91 a 180	9.1 %	9.0 %
>180	-	-
<b>Total</b>	<b>10.0 %</b>	<b>10.5 %</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	492	5	24	266	189	23	40	297	328
<b>Real</b>	63	24	164	208	22	3	60	137	37	21	160	130
<b>Total</b>	117	117	700	700	27	27	326	326	60	60	457	457

\* 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 14 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.