

Fecha de publicación: 19 de Agosto 2003  
 Fecha de Información: 14 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\$119.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	45.8	10.2	0.2	35.8	46.0
15 a 35	27.7	14.0	2.4	16.1	30.1
36 a 60	0.5	2.0	1.5	-	2.0
61 a 90	3.0	11.3	8.3	-	11.3
91 a 180	-	29.6	29.6	-	29.6
>180	-	0.2	0.2	-	0.2
<b>Total</b>	<b>77.0</b>	<b>67.3</b>	<b>42.2</b>	<b>51.9</b>	<b>119.2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	7.2 %	3.9 %
15 a 35	9.6 %	10.9 %
36 a 60	8.8 %	8.2 %
61 a 90	9.1 %	9.2 %
91 a 180	9.4 %	9.6 %
>180	9.1 %	9.0 %
<b>Total</b>	<b>9.0 %</b>	<b>7.7 %</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	304	199	23	40	305	328
<b>Real</b>	63	24	164	208	22	3	60	165	37	21	160	138
<b>Total</b>	117	117	700	700	27	27	363	363	61	61	465	465

\* 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 15 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.