

Fecha de publicación: 20 de Agosto 2003
 Fecha de Información: 15 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\$81.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	40.5	5.2	0.2	35.5	40.7
15 a 35	32.0	18.1	0.1	14.0	32.1
36 a 60	1.0	2.4	1.4	-	2.4
61 a 90	1.0	1.7	0.7	-	1.7
91 a 180	-	3.5	3.5	-	3.5
>180	-	0.9	0.9	-	0.9
Total	74.5	31.8	6.8	49.5	81.3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	5.5 %	6.1 %
15 a 35	8.9 %	8.8 %
36 a 60	9.3 %	8.9 %
61 a 90	9.6 %	9.2 %
91 a 180	9.3 %	9.2 %
>180	9.1 %	9.1 %
Total	8.2 %	7.5 %

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	7	24	306	199	24	40	342	333
Real	63	24	164	208	22	5	60	167	37	21	160	169
Total	117	117	700	700	29	29	365	365	61	61	502	502

* 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 18 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.