

Fecha de publicación: 21 de Agosto 2003  
 Fecha de Información: 19 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\$121.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	29.6	19.0	-	10.6	29.6
15 a 35	84.2	29.2	-	55.0	84.2
36 a 60	4.2	-	-	4.2	4.2
61 a 90	-	0.2	0.2	-	0.2
91 a 180	-	1.5	1.5	-	1.5
>180	1.7	-	-	1.7	1.7
<b>Total</b>	<b>119.7</b>	<b>49.9</b>	<b>1.7</b>	<b>71.5</b>	<b>121.5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.5 %	12.2 %
15 a 35	8.5 %	9.3 %
36 a 60	9.1 %	8.9 %
61 a 90	9.4 %	9.4 %
91 a 180	9.4 %	9.3 %
>180	6.5 %	6.5 %
<b>Total</b>	<b>8.9 %</b>	<b>10.0 %</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**

Sectores	18 al 22 de Agosto				25 al 29 de Agosto				1 al 5 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	7	22	306	200	24	40	371	352	32	15	186	95
<b>Real</b>	20	5	61	167	37	21	160	179	11	28	13	104
<b>Total</b>	28	28	367	367	61	61	531	531	44	44	199	199

\* 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 20 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.