

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

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
Total	119.7	49.9	1.7	71.5	121.5

* 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 %
Total	8.9 %	10.0 %

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	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
Financiero	7	22	306	200	24	40	371	352	32	15	186	95
Real	20	5	61	167	37	21	160	179	11	28	13	104
Total	28	28	367	367	61	61	531	531	44	44	199	199

* 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 20 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.