

Fecha de publicación: 22 de Agosto 2003
 Fecha de Información: 20 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\$84.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	16.3	5.0	4.6	15.9	20.9
15 a 35	40.5	22.9	3.9	21.5	44.4
36 a 60	4.8	8.3	3.5	-	8.3
61 a 90	2.0	4.4	2.4	-	4.4
91 a 180	2.0	2.8	2.8	2.0	4.8
>180	-	1.9	1.9	-	1.9
Total	65.6	45.3	19.1	39.4	84.7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	6.1 %	4.7 %
15 a 35	9.2 %	9.3 %
36 a 60	8.1 %	7.8 %
61 a 90	9.2 %	8.6 %
91 a 180	9.0 %	8.7 %
>180	9.0 %	8.9 %
Total	8.4 %	7.9 %

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	25	42	376	355	33	15	211	101
Real	20	5	61	167	39	22	163	184	12	29	13	123
Total	28	28	367	367	64	64	539	539	44	44	224	224

* 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 21 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.