

Fecha de publicación: 25 de Agosto 2003
 Fecha de Información: 21 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\$192.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	46.7	27.0	15.0	34.7	61.7
15 a 35	79.5	27.8	4.8	56.5	84.3
36 a 60	1.0	3.6	2.6	-	3.6
61 a 90	-	24.4	24.4	-	24.4
91 a 180	1.6	16.2	14.7	0.1	16.3
>180	2.1	0.2	0.2	2.1	2.3
Total	130.9	99.2	61.7	93.4	192.6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.2 %	8.6 %
15 a 35	9.5 %	8.8 %
36 a 60	9.0 %	8.1 %
61 a 90	9.2 %	9.2 %
91 a 180	9.4 %	9.3 %
>180	8.9 %	8.6 %
Total	9.3 %	8.8 %

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	26	43	385	364	33	15	260	118
Real	20	5	61	167	40	22	167	188	12	29	23	165
Total	28	28	367	367	65	65	552	552	44	44	283	283

* 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 22 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.