

Fecha de publicación: 26 de Agosto 2003
 Fecha de Información: 22 de Agosto de 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\$183.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	83.0	45.6	3.4	40.9	86.4
15 a 35	70.6	7.7	0.7	63.6	71.4
36 a 60	1.0	2.2	1.2	-	2.2
61 a 90	0.0	1.8	1.7	-	1.8
91 a 180	-	11.8	11.8	-	11.8
>180	0.6	9.6	9.0	-	9.6
Total	155.3	78.7	27.9	104.5	183.2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	10.5 %	9.4 %
15 a 35	9.4 %	7.6 %
36 a 60	8.2 %	7.9 %
61 a 90	9.1 %	9.4 %
91 a 180	9.1 %	9.2 %
>180	9.2 %	9.2 %
Total	9.3 %	8.6 %

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	390	369	90	51	280	123
Real	20	5	61	167	40	23	170	191	12	51	23	180
Total	28	28	367	367	66	66	560	560	102	102	303	303

* 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 25 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.