

Fecha de publicación: 28 de Agosto 2003
 Fecha de Información: 26 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\$88.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	25.1	1.9	1.6	24.8	26.7
15 a 35	52.8	10.7	1.4	43.5	54.2
36 a 60	1.5	2.3	0.8	-	2.3
61 a 90	3.0	4.0	1.0	-	4.0
91 a 180	0.1	1.7	1.6	-	1.7
>180	-	-	-	-	-
Total	82.5	20.5	6.4	68.3	88.8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	10.6 %	14.0 %
15 a 35	9.0 %	8.7 %
36 a 60	9.7 %	9.3 %
61 a 90	9.9 %	9.5 %
91 a 180	10.1 %	9.5 %
>180	-	-
Total	9.6 %	10.4 %

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

Sectores	25 al 29 de Agosto				1 al 5 de Septiembre				8 al 12 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	28	44	396	376	90	51	308	124	13	25	211	93
Real	41	24	171	191	12	51	23	208	24	12	44	163
Total	69	69	567	567	102	102	331	331	36	36	255	255

* 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 27 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.