

Fecha de la información: 15 de Julio de 2003 ¹

Fecha de publicación: 17 de julio de 2003

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$102.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	32.9	49.2	20.6	4.3	53.5
15 a 35	32.6	13.1	7.1	26.6	39.6
36 a 60	1.2	1.1	0.1	0.2	1.3
61 a 90	0.5	0.1	0.1	0.5	0.6
91 a 180	0.5	3.2	3.2	0.5	3.7
>180	-	4.0	4.0	-	4.0
Total	67.7	70.6	34.9	32.0	102.6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.1 %	9.1 %
15 a 35	9.0 %	9.6 %
36 a 60	9.1 %	8.6 %
61 a 90	10.1 %	8.4 %
91 a 180	8.9 %	7.4 %
>180	9.2 %	9.2 %
Total	9.1 %	9.3 %

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	14 al 18 de Julio				21 al 25 de Julio				28 de Jul. al 1 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	22	20	456	341	10	27	320	240	26	19	286	286
Real	15	17	104	220	26	9	33	113	15	22	115	115
Total	37	37	561	561	35	35	353	353	41	41	401	401

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (\text{Plazo}/365)) - 1$

³ A partir del 16 de julio se presenta la proyección de vencimientos.