

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha información: 16 de Julio de 2003 ¹

Fecha de publicación: 18 de julio de 2003

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$102.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	3.2	7.8	5.1	0.6	8.3
15 a 35	43.5	36.2	9.4	16.7	52.9
36 a 60	0.2	0.1	0.1	0.2	0.3
61 a 90	16.6	1.5	0.2	15.3	16.8
91 a 180	-	3.8	3.8	-	3.8
>180	10.2	10.2	10.2	10.2	20.4
Total	73.7	59.5	28.8	43.0	102.5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	6.3 %	9.0 %
15 a 35	9.4 %	9.4 %
36 a 60	9.7 %	9.4 %
61 a 90	9.1 %	8.7 %
91 a 180	9.6 %	9.1 %
>180	9.3 %	9.2 %
Total	8.9 %	9.2 %

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	436	341	10	27	320	245	26	19	288	289
Real	15	17	104	200	26	9	38	113	15	22	115	115
Total	37	37	541	541	36	36	358	358	41	41	404	404

* 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 17 de julio se presenta la proyección de vencimientos.