

Fecha de publicación: 23 de Julio 2003  
 Fecha de Información: 21 de Julio 2003 <sup>1</sup>

### INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$83.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	33.8	14.3	0.1	19.6	33.8
15 a 35	44.9	32.5	0.0	12.4	44.9
36 a 60	0.1	-	-	0.1	0.1
61 a 90	-	0.0	0.0	-	0.0
91 a 180	-	0.1	0.1	-	0.1
>180	-	4.0	4.0	-	4.0
<b>Total</b>	<b>78.7</b>	<b>51.0</b>	<b>4.3</b>	<b>32.0</b>	<b>83.0</b>

\* Cifras en millones de dólares

**Cuadro No. 2**  
**Devaluación Implícita Anualizada**

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.9 %	7.4 %
15 a 35	8.4 %	8.4 %
36 a 60	7.6 %	7.6 %
61 a 90	9.2 %	9.4 %
91 a 180	9.3 %	9.3 %
>180	9.0 %	9.0 %
<b>Total</b>	<b>8.9 %</b>	<b>8.0 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	21 al 25 de Julio				28 de Jul. al 1 de Agosto				4 al 8 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	13	27	347	247	28	19	330	308	17	19	302	284
<b>Real</b>	26	11	20	120	15	24	115	137	13	11	96	114
<b>Total</b>	39	39	367	367	43	43	445	445	30	30	398	398

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

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

<sup>3</sup> A partir del 22 de julio se presenta la proyección de vencimientos.