

Fecha de publicación: 24 de Julio 2003
 Fecha de Información: 22 de Julio 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\$81.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	11.4	10.1	0.1	1.4	11.5
15 a 35	41.9	24.6	2.7	20.0	44.6
36 a 60	6.3	8.1	1.8	-	8.1
61 a 90	-	0.0	0.0	-	0.0
91 a 180	2.0	3.5	3.5	2.0	5.5
>180	7.5	6.0	4.0	5.5	11.5
Total	69.2	52.4	12.1	28.9	81.3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.1 %	6.4 %
15 a 35	9.0 %	9.0 %
36 a 60	9.7 %	10.5 %
61 a 90	9.7 %	9.7 %
91 a 180	9.7 %	9.1 %
>180	8.9 %	8.9 %
Total	9.2 %	8.8 %

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	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
Financiero	13	27	352	252	29	19	335	314	17	19	302	284
Real	26	12	20	120	15	25	116	137	13	11	96	114
Total	39	39	372	372	44	44	450	450	30	30	398	398

* 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 23 de julio se presenta la proyección de vencimientos.