

Fecha de publicación: 3 de Julio 2003
Fecha de Información: 1 de Julio 2003¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$37.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	14.9	6.0	-	8.9	14.9
15 a 35	12.6	4.3	-	8.3	12.6
36 a 60	1.0	2.0	1.0	-	2.0
61 a 90	1.0	0.0	0.0	1.0	1.0
91 a 180	2.3	6.6	4.3	-	6.6
>180	-	-	-	-	-
Total	31.8	19.0	5.4	18.2	37.1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	10.7 %	9.4 %
15 a 35	9.2 %	9.5 %
36 a 60	9.7 %	9.6 %
61 a 90	9.6 %	9.1 %
91 a 180	10.0 %	9.7 %
>180	-	-
Total	9.8 %	9.5 %

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	30 de Jun. al 4 de Julio				7 al 11 de Julio				14 al 18 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	14	18	281	106	35	36	415	261	6	17	290	198
Real	16	12	21	196	23	22	70	225	13	2	63	155
Total	30	30	302	302	58	58	485	485	19	19	353	353

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

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

³ A partir del 2 de julio se presenta la proyección de vencimientos.