

Fecha de publicación: 7 de Julio 2003
Fecha de Información: 3 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\$214.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	109.6	46.5	-	63.1	109.6
15 a 35	30.0	8.5	-	21.5	30.0
36 a 60	20.0	21.8	1.8	-	21.8
61 a 90	0.0	0.1	0.1	0.0	0.1
91 a 180	-	4.2	4.2	-	4.2
>180	49.0	-	-	49.0	49.0
Total	208.6	81.1	6.1	133.6	214.7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.4 %	8.7 %
15 a 35	9.8 %	10.1 %
36 a 60	10.0 %	9.7 %
61 a 90	9.5 %	9.5 %
91 a 180	9.9 %	9.5 %
>180	9.0 %	9.0 %
Total	9.0 %	9.1 %

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	40	37	478	281	9	18	387	271
Real	16	12	21	196	23	26	70	267	13	5	63	179
Total	30	30	302	302	63	63	548	548	23	23	450	450

* 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 4 de julio se presenta la proyección de vencimientos.