

Fecha de publicación: 8 de Julio 2003  
 Fecha de Información: 4 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\$120.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	91.3	49.1	0.1	42.3	91.4
15 a 35	24.2	7.9	0.4	16.7	24.6
36 a 60	-	-	-	-	-
61 a 90	-	0.4	0.4	-	0.4
91 a 180	3.0	3.6	0.6	-	3.6
>180	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>118.5</b>	<b>61.0</b>	<b>1.5</b>	<b>59.0</b>	<b>120.0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.1 %	8.3 %
15 a 35	8.9 %	9.1 %
36 a 60	-	-
61 a 90	10.7 %	10.7 %
91 a 180	10.1 %	10.0 %
>180	-	-
<b>Total</b>	<b>8.7 %</b>	<b>8.6 %</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	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
<b>Financiero</b>	14	18	281	106	40	37	547	320	10	18	409	281
<b>Real</b>	16	12	21	196	23	26	70	297	13	5	63	191
<b>Total</b>	30	30	302	302	63	63	617	617	23	23	472	472

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

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

<sup>3</sup> A partir del 7 de julio se presenta la proyección de vencimientos.