

Fecha de publicación: 11 de Julio 2003  
 Fecha de Información: 9 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\$61.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	8.1	10.5	5.5	3.1	13.6
15 a 35	38.0	15.0	0.5	23.5	38.5
36 a 60	0.0	0.0	0.0	0.0	0.1
61 a 90	4.4	1.2	0.2	3.4	4.6
91 a 180	2.2	0.1	0.1	2.2	2.3
>180	2.0	-	-	2.0	2.0
<b>Total</b>	<b>54.8</b>	<b>26.9</b>	<b>6.4</b>	<b>34.3</b>	<b>61.2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.1 %	7.6 %
15 a 35	9.9 %	9.8 %
36 a 60	7.7 %	7.5 %
61 a 90	9.4 %	9.0 %
91 a 180	9.1 %	9.2 %
>180	9.4 %	9.4 %
<b>Total</b>	<b>9.1 %</b>	<b>9.2 %</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**

Sector	7 al 11 de Julio				14 al 18 de Julio				21 al 25 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	50	40	550	323	16	20	421	313	6	26	190	137
<b>Real</b>	23	34	70	297	15	12	84	192	25	5	13	67
<b>Total</b>	73	73	620	620	32	32	505	505	32	32	203	203

\* 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 10 de julio se presenta la proyección de vencimientos.