

**Fecha de Publicación: 15 de julio de 2003**

**Fecha de Información: 11 de julio de 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\$149.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	35.2	15.1	0.1	20.2	35.3
15 a 35	109.1	88.5	-	20.6	109.1
36 a 60	0.1	0.4	0.4	0.1	0.5
61 a 90	0.1	0.2	0.2	0.1	0.3
91 a 180	-	0.3	0.3	-	0.3
>180	-	4.0	4.0	-	4.0
<b>Total</b>	<b>144.6</b>	<b>108.5</b>	<b>5.0</b>	<b>41.1</b>	<b>149.5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	10.2 %	10.1 %
15 a 35	7.5 %	6.9 %
36 a 60	9.8 %	9.9 %
61 a 90	10.0 %	9.7 %
91 a 180	10.5 %	10.4 %
>180	9.0 %	9.0 %
<b>Total</b>	<b>8.8 %</b>	<b>7.7 %</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	21	20	436	321	7	26	256	175
<b>Real</b>	23	34	70	297	15	16	84	200	25	6	13	94
<b>Total</b>	74	74	620	620	36	36	521	521	33	33	269	269

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

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

<sup>3</sup> A partir del 14 de julio se presenta la proyección de vencimientos.