

Fecha de Publicación: 16 de julio de 2003

Fecha de Información: 14 de Julio de 2003 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$120.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6.2%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	39.0	37.0	20.0	22.0	59.0
15 a 35	39.2	14.5	4.9	29.6	44.1
36 a 60	2.7	7.5	5.9	1.2	8.6
61 a 90	2.5	0.0	0.0	2.5	2.5
91 a 180	2.0	2.7	0.7	-	2.7
>180	-	4.0	4.0	-	4.0
Total	85.3	65.8	35.6	55.2	120.9

* Cifras en millones de dólares

**Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada**

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	12.0 %	5.2 %
15 a 35	9.5 %	6.8 %
36 a 60	7.7 %	7.5 %
61 a 90	7.7 %	7.3 %
91 a 180	9.0 %	8.4 %
>180	9.1 %	9.1 %
Total	9.6 %	6.2 %

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**

Sector	14 al 18 de Julio				21 al 25 de Julio				28 de Jul. al 1 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	22	20	436	341	9	26	291	192	25	19	282	286
Real	15	17	104	200	25	8	13	112	15	21	115	111
Total	37	37	541	541	34	34	304	304	40	40	397	397

* 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 15 de julio se presenta la proyección de vencimientos.