

Fecha de publicación: 21 de Julio 2003
 Fecha de Información: 17 de Julio 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\$98.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	21.1	12.0	2.0	11.1	23.1
15 a 35	62.4	51.6	0.6	11.4	63.0
36 a 60	1.1	0.0	0.0	1.1	1.2
61 a 90	1.7	-	-	1.7	1.7
91 a 180	-	2.0	2.0	-	2.0
>180	0.8	6.4	6.4	0.8	7.2
Total	87.2	72.0	11.0	26.1	98.2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	5.8 %	13.4 %
15 a 35	8.8 %	9.3 %
36 a 60	8.1 %	7.5 %
61 a 90	7.5 %	7.8 %
91 a 180	9.2 %	9.3 %
>180	9.0 %	8.7 %
Total	7.7 %	10.2 %

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

Sectores	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	321	12	27	336	237	27	19	297	294
Real	15	17	84	200	26	11	20	119	15	23	115	118
Total	37	37	521	521	38	38	356	356	42	42	412	412

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

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

³ A partir del 18 de julio se presenta la proyección de vencimientos.