

Fecha de publicación: 22 de Julio 2003
 Fecha de Información: 18 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\$129.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	12.5	10.0	-	2.5	12.5
15 a 35	85.3	55.7	10.0	39.7	95.3
36 a 60	0.1	-	-	0.1	0.1
61 a 90	-	0.2	0.2	-	0.2
91 a 180	6.0	9.4	3.4	-	9.4
>180	7.0	4.9	4.9	7.0	11.9
Total	110.9	80.1	18.5	49.2	129.3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.8 %	11.1 %
15 a 35	8.7 %	8.7 %
36 a 60	7.4 %	7.4 %
61 a 90	8.0 %	6.5 %
91 a 180	9.6 %	9.3 %
>180	9.2 %	9.1 %
Total	9.0 %	9.0 %

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	347	247	28	19	297	294
Real	15	17	84	200	26	11	20	120	15	24	115	118
Total	37	37	521	521	38	38	367	367	43	43	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 21 de julio se presenta la proyección de vencimientos.