

Fecha de publicación: 28 de Julio 2003  
 Fecha de Información: 24 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\$84.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	10.6	6.2	2.0	6.4	12.6
15 a 35	44.2	31.9	2.2	14.5	46.4
36 a 60	8.4	1.3	-	7.1	8.4
61 a 90	-	1.3	1.3	-	1.3
91 a 180	5.0	0.1	0.1	5.0	5.1
>180	6.1	6.1	4.1	4.1	10.2
<b>Total</b>	<b>74.3</b>	<b>46.9</b>	<b>9.7</b>	<b>37.1</b>	<b>84.0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	5.2 %	8.2 %
15 a 35	8.5 %	8.6 %
36 a 60	8.0 %	7.8 %
61 a 90	9.8 %	9.3 %
91 a 180	9.7 %	9.1 %
>180	8.8 %	8.9 %
<b>Total</b>	<b>8.0 %</b>	<b>8.5 %</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**

Sectores	21 al 25 de Julio				28 de Jul. al 1 de Agosto				4 al 8 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	13	27	352	252	30	19	379	365	32	19	312	293
<b>Real</b>	26	12	20	120	15	25	125	139	13	27	96	115
<b>Total</b>	39	39	372	372	45	45	504	504	46	46	408	408

\* 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 25 de julio se presenta la proyección de vencimientos.