

Fecha de publicación: 29 de Julio 2003
 Fecha de Información: 25 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\$111.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	30.2	18.8	0.3	11.7	30.4
15 a 35	30.9	13.7	0.4	17.6	31.3
36 a 60	5.0	0.2	0.2	5.0	5.2
61 a 90	10.4	16.5	6.1	-	16.5
91 a 180	5.2	9.1	4.1	0.2	9.3
>180	19.0	-	-	19.0	19.0
Total	100.6	58.3	11.1	53.4	111.7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.0 %	10.0 %
15 a 35	9.7 %	9.6 %
36 a 60	10.0 %	8.6 %
61 a 90	9.9 %	10.1 %
91 a 180	9.8 %	9.5 %
>180	8.8 %	8.8 %
Total	9.2 %	9.6 %

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	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
Financiero	13	27	352	252	30	20	384	370	33	19	337	307
Real	26	12	20	120	15	26	125	139	13	27	96	126
Total	39	39	372	372	45	45	509	509	46	46	433	433

* 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 28 de julio se presenta la proyección de vencimientos.