

Fecha de publicación: 30 de Julio 2003
 Fecha de Información: 28 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\$56.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	27.3	10.3	0.5	17.5	27.8
15 a 35	17.3	16.7	0.1	0.7	17.4
36 a 60	-	0.9	0.9	-	0.9
61 a 90	-	1.0	1.0	-	1.0
91 a 180	1.3	9.7	8.4	-	9.7
>180	-	0.0	0.0	-	0.0
Total	45.9	38.6	11.0	18.2	56.8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.5 %	5.9 %
15 a 35	8.6 %	8.9 %
36 a 60	9.0 %	8.4 %
61 a 90	9.8 %	9.8 %
91 a 180	9.2 %	9.2 %
>180	9.4 %	9.4 %
Total	8.9 %	7.5 %

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	28 de Jul. al 1 de Agosto				4 al 8 de Agosto				11 al 15 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	31	20	384	370	34	19	343	312	34	83	355	359
Real	16	26	125	139	13	28	96	126	62	13	135	131
Total	46	46	509	509	47	47	439	439	97	97	490	490

* 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 29 de julio se presenta la proyección de vencimientos.