

Fecha de publicación: 31 de Julio 2003  
 Fecha de Información: 29 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\$70.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	4.7	1.3	1.1	4.5	5.8
15 a 35	48.6	24.0	1.6	26.2	50.2
36 a 60	-	0.3	0.3	-	0.3
61 a 90	5.5	5.0	0.0	0.5	5.5
91 a 180	5.0	8.6	3.6	-	8.6
>180	-	0.3	0.3	-	0.3
<b>Total</b>	<b>63.8</b>	<b>39.5</b>	<b>6.9</b>	<b>31.2</b>	<b>70.7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	6.7 %	19.2 %
15 a 35	9.6 %	9.4 %
36 a 60	10.1 %	10.7 %
61 a 90	8.8 %	9.5 %
91 a 180	9.4 %	9.7 %
>180	9.3 %	9.3 %
<b>Total</b>	<b>9.2 %</b>	<b>10.2 %</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**

Sector	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
<b>Financiero</b>	31	20	384	371	34	19	347	312	35	83	356	359
<b>Real</b>	16	26	126	139	13	28	96	130	62	14	135	131
<b>Total</b>	47	47	510	510	47	47	443	443	98	98	490	490

\* 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 30 de julio se presenta la proyección de vencimientos.