

Fecha de publicación: 4 de Agosto 2003  
 Fecha de Información: 31 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\$97.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	21.4	20.0	6.0	7.4	27.4
15 a 35	13.1	3.0	2.5	12.6	15.6
36 a 60	0.2	2.5	2.5	0.2	2.7
61 a 90	0.1	2.3	2.3	0.1	2.4
91 a 180	12.0	22.9	10.9	-	22.9
>180	17.0	20.9	9.9	6.0	26.9
<b>Total</b>	<b>63.8</b>	<b>71.7</b>	<b>34.2</b>	<b>26.3</b>	<b>97.9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	5.2 %	5.6 %
15 a 35	6.8 %	7.3 %
36 a 60	7.9 %	8.0 %
61 a 90	9.4 %	9.3 %
91 a 180	9.5 %	9.3 %
>180	9.0 %	9.2 %
<b>Total</b>	<b>7.7 %</b>	<b>7.9 %</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	37	19	350	318	36	83	394	384
<b>Real</b>	16	26	126	139	13	31	102	134	62	15	135	145
<b>Total</b>	47	47	510	510	50	50	452	452	99	99	529	529

\* 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 1 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.