

Fecha de publicación: 24 de Junio 2003
Fecha de Información: 19 de Junio 2003¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$108.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	12.4	6.1	1.1	7.4	13.5
15 a 35	54.7	27.7	10.7	37.7	65.4
36 a 60	7.0	19.2	12.2	-	19.2
61 a 90	-	3.5	3.5	-	3.5
91 a 180	-	0.4	0.4	-	0.4
>180	3.0	3.4	3.4	3.0	6.4
Total	77.1	60.3	31.3	48.1	108.4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	5.4 %	7.8 %
15 a 35	9.1 %	8.9 %
36 a 60	10.4 %	10.2 %
61 a 90	10.1 %	9.9 %
91 a 180	9.8 %	9.7 %
>180	9.6 %	9.4 %
Total	8.8 %	9.1 %

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	16 al 20 de Junio				23 al 27 de Junio				30 de Jun. al 4 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	27	45	574	354	28	103	517	447	10	16	215	93
Real	28	10	76	296	91	15	144	214	15	9	20	142
Total	55	55	650	650	119	119	661	661	25	25	235	235

* 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 20 de junio se presenta la proyección de vencimientos.