

Fecha de publicación: 25 de Junio 2003
 Fecha de Información: 20 de Junio 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\$95.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	38.6	15.4	1.4	24.6	39.9
15 a 35	47.1	27.0	-	20.1	47.1
36 a 60	0.1	0.2	0.1	-	0.2
61 a 90	1.8	0.7	0.5	1.5	2.2
91 a 180	-	1.3	1.3	-	1.3
>180	-	4.7	4.7	-	4.7
Total	87.6	49.4	8.0	46.2	95.6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.8 %	7.3 %
15 a 35	9.2 %	9.3 %
36 a 60	10.8 %	10.8 %
61 a 90	10.4 %	9.6 %
91 a 180	10.7 %	11.2 %
>180	15.6 %	11.4 %
Total	9.7 %	8.6 %

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

Sector	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	528	459	10	16	241	96
Real	28	10	76	296	91	16	145	214	15	10	21	166
Total	55	55	650	650	120	120	673	673	25	25	262	262

* 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 23 de junio se presenta la proyección de vencimientos.