

**Fecha de publicación: 27 de Junio 2003**  
**Fecha de Información: 25 de Junio 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\$105.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	10.7	13.1	6.1	3.6	16.7
15 a 35	61.5	46.0	6.5	22.0	68.0
36 a 60	9.2	10.4	1.2	-	10.4
61 a 90	0.3	1.0	1.0	0.3	1.3
91 a 180	0.3	3.5	3.2	-	3.5
>180	-	5.4	5.4	-	5.4
<b>Total</b>	<b>81.9</b>	<b>79.4</b>	<b>23.3</b>	<b>25.9</b>	<b>105.2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.2 %	8.1 %
15 a 35	9.5 %	9.3 %
36 a 60	10.6 %	10.3 %
61 a 90	10.2 %	9.9 %
91 a 180	10.2 %	10.3 %
>180	11.0 %	20.6 %
<b>Total</b>	<b>9.9 %</b>	<b>9.8 %</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**

Sectores	23 al 27 de Junio				30 de Jun. al 4 de Julio				7 al 11 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	28	102	528	460	10	16	250	98	6	27	386	234
<b>Real</b>	90	16	146	214	15	10	21	172	23	3	70	222
<b>Total</b>	119	119	674	674	26	26	270	270	29	29	456	456

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (\text{Plazo}/365)) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 26 de junio se presenta la proyección de vencimientos.