

**Fecha de publicación: 1 de Julio 2003**  
**Fecha de Información: 26 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\$123.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	61.9	23.6	0.1	38.4	61.9
15 a 35	44.1	35.7	0.7	9.1	44.8
36 a 60	10.0	10.0	-	-	10.0
61 a 90	0.3	1.1	0.8	-	1.1
91 a 180	0.0	5.3	5.3	-	5.3
>180	-	0.1	0.1	-	0.1
<b>Total</b>	<b>116.2</b>	<b>75.6</b>	<b>6.8</b>	<b>47.5</b>	<b>123.1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.7 %	8.4 %
15 a 35	10.0 %	10.3 %
36 a 60	10.6 %	11.2 %
61 a 90	11.2 %	11.2 %
91 a 180	10.5 %	9.7 %
>180	9.7 %	9.7 %
<b>Total</b>	<b>9.7 %</b>	<b>9.4 %</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	14	18	281	106	24	35	403	249
<b>Real</b>	90	16	146	214	16	12	21	195	23	13	70	225
<b>Total</b>	119	119	674	674	30	30	301	301	47	47	473	473

\* 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 27 de junio se presenta la proyección de vencimientos.