

Fecha de publicación: 20 de Junio 2003
Fecha de Información: 18 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\$60.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	5.5	6.3	4.5	3.7	10.0
15 a 35	42.4	11.0	-	31.4	42.4
36 a 60	-	-	-	-	-
61 a 90	6.7	1.1	1.1	6.7	7.8
91 a 180	-	0.1	0.1	-	0.1
>180	-	0.2	0.2	-	0.2
Total	54.6	18.7	5.9	41.8	60.5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	6.8 %	6.2 %
15 a 35	9.2 %	9.7 %
36 a 60	-	-
61 a 90	8.3 %	8.7 %
91 a 180	9.9 %	9.9 %
>180	9.9 %	9.9 %
Total	8.4 %	9.0 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

¹ Datos provisionales.

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

³ A partir del 19 de junio se presenta la proyección de vencimientos.

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	26	102	517	446	10	16	181	84
Real	28	10	76	296	91	15	143	214	15	9	20	118
Total	55	55	650	650	117	117	660	660	25	25	202	202

* Cifras en millones de dólares