

Fecha de publicación: 2 de Julio 2003
Fecha de Información: 27 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\$59.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3 a 14 | 8.3 | 7.6 | 0.6 | 1.3 | 9.0 |
| 15 a 35 | 35.5 | 4.8 | 0.3 | 31.0 | 35.8 |
| 36 a 60 | 1.0 | 1.3 | 0.3 | - | 1.3 |
| 61 a 90 | 1.0 | 1.0 | 0.0 | - | 1.0 |
| 91 a 180 | 7.0 | 6.6 | 4.6 | 5.0 | 11.6 |
| >180 | - | 0.8 | 0.8 | - | 0.8 |
| Total | 52.8 | 22.2 | 6.7 | 37.3 | 59.5 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3 a 14 | 8.4 % | 3.9 % |
| 15 a 35 | 8.8 % | 8.5 % |
| 36 a 60 | 10.2 % | 10.9 % |
| 61 a 90 | 10.9 % | 10.1 % |
| 91 a 180 | 9.9 % | 9.7 % |
| >180 | 10.1 % | 10.1 % |
| Total | 9.2 % | 8.1 % |

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 | 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 |
| Financiero | 28 | 102 | 528 | 460 | 14 | 18 | 281 | 106 | 25 | 35 | 410 | 256 |
| Real | 90 | 16 | 146 | 214 | 16 | 12 | 21 | 196 | 23 | 14 | 70 | 225 |
| Total | 119 | 119 | 674 | 674 | 30 | 30 | 302 | 302 | 48 | 48 | 480 | 480 |

* 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 30 de junio se presenta la proyección de vencimientos.