

Fecha de publicación: 10 de Junio de 2004
Fecha de Información: 8 de Junio de 2004¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$181,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|-------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 44,2 | 65,6 | 39,6 | 18,2 | 83,7 |
| 15-35 | 32,6 | 44,0 | 17,8 | 6,4 | 50,3 |
| 36-60 | 15,1 | 15,4 | 0,3 | 0,0 | 15,4 |
| 61-90 | 10,1 | 12,1 | 2,0 | 0,0 | 12,1 |
| 91-180 | - | 3,6 | 3,6 | - | 3,6 |
| >180 | - | 16,5 | 16,5 | - | 16,5 |
| Total | 102,0 | 157,1 | 79,7 | 24,6 | 181,7 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 7,3 % | 6,5 % |
| 15-35 | 5,9 % | 6,4 % |
| 36-60 | 6,3 % | 5,8 % |
| 61-90 | 7,0 % | 6,0 % |
| 91-180 | 7,1 % | 7,1 % |
| >180 | 7,6 % | 7,4 % |
| Total | 6,7 % | 6,5 % |

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 | 7 al 11 de Junio | | | | 14 al 18 de Junio | | | | 21 al 25 de Junio | | | |
|-------------------|------------------|----|-----|-----|-------------------|----|-----|-----|-------------------|----|-----|-----|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Financiero | 38 | 45 | 613 | 545 | 37 | 44 | 335 | 312 | 24 | 64 | 315 | 246 |
| Real | 27 | 20 | 115 | 183 | 34 | 27 | 108 | 131 | 51 | 10 | 39 | 108 |
| Total | 65 | 65 | 728 | 728 | 71 | 71 | 442 | 442 | 74 | 74 | 354 | 354 |

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

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

³ A partir del 9 de junio se presenta la proyección de vencimientos.