

Fecha de publicación: 5 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 3 de Agosto de 2004 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\$127,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|-------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 44,2 | 36,5 | 4,5 | 12,2 | 48,7 |
| 15-35 | 39,0 | 44,0 | 12,0 | 7,0 | 51,0 |
| 36-60 | 3,0 | 5,3 | 2,3 | - | 5,3 |
| 61-90 | 0,4 | 1,9 | 1,6 | 0,1 | 1,9 |
| 91-180 | 10,0 | 8,0 | 3,0 | 5,0 | 13,0 |
| >180 | - | 7,8 | 7,8 | - | 7,8 |
| Total | 96,5 | 103,4 | 31,1 | 24,2 | 127,7 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 4,1 % | 3,9 % |
| 15-35 | 4,9 % | 4,6 % |
| 36-60 | 5,9 % | 5,5 % |
| 61-90 | 5,9 % | 5,8 % |
| 91-180 | 6,8 % | 6,2 % |
| >180 | 7,1 % | 7,2 % |
| Total | 5,7 % | 4,7 % |

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 | 2 al 6 de Agosto | | | | 9 al 13 de Agosto | | | | 16 al 20 de Agosto | | | |
|-------------------|------------------|----|-----|-----|-------------------|----|-----|-----|--------------------|----|-----|-----|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Financiero | 6 | 54 | 392 | 371 | 9 | 92 | 283 | 284 | 9 | 48 | 309 | 261 |
| Real | 53 | 5 | 134 | 154 | 90 | 7 | 93 | 92 | 48 | 8 | 93 | 141 |
| Total | 59 | 59 | 526 | 526 | 99 | 99 | 376 | 376 | 56 | 56 | 402 | 402 |

* 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 4 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.