

Fecha de publicación: 3 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 30 de Julio 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\$125,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	34,0	30,9	2,9	6,0	36,9
15-35	18,8	59,7	43,0	2,1	61,8
36-60	1,0	4,6	3,6	-	4,6
61-90	12,0	12,7	0,7	-	12,7
91-180	-	5,6	5,6	-	5,6
>180	-	3,6	3,6	-	3,6
Total	65,8	117,0	59,3	8,1	125,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8,7 %	5,1 %
15-35	4,7 %	5,1 %
36-60	5,3 %	5,2 %
61-90	5,5 %	4,7 %
91-180	6,3 %	6,0 %
>180	6,9 %	7,1 %
Total	6,2 %	5,1 %

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	26 al 30 de Julio				2 al 6 de Agosto				9 al 13 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	31	69	382	338	6	54	387	359	9	92	249	259
Real	53	15	122	165	53	5	127	154	90	7	93	83
Total	84	84	503	503	59	59	514	514	99	99	342	342

* 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 2 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.