

Fecha de publicación: 4 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 2 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\$78,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,3	7,0	7,0	2,3	9,3
15-35	40,6	29,5	3,5	14,6	44,1
36-60	3,5	3,6	0,1	-	3,6
61-90	0,3	1,0	1,0	0,3	1,3
91-180	5,0	6,8	1,8	-	6,8
>180	5,0	8,3	8,3	5,0	13,3
Total	56,6	56,1	21,6	22,1	78,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	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	387	366	9	92	251	259	9	47	302	255
Real	53	5	134	154	90	7	93	85	46	8	89	136
Total	59	59	521	521	99	99	344	344	55	55	391	391

* 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 3 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.