

Fecha de publicación: 10 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 6 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\$193,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,5	28,3	5,3	21,5	49,8
15-35	74,0	53,6	18,3	38,7	92,3
36-60	2,2	10,4	8,4	0,2	10,6
61-90	1,1	3,5	3,5	1,1	4,6
91-180	2,5	15,8	15,8	2,5	18,3
>180	1,0	16,8	16,8	1,0	17,8
Total	125,2	128,4	68,1	64,9	193,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8,3 %	10,0 %
15-35	4,4 %	4,0 %
36-60	5,5 %	4,6 %
61-90	6,2 %	5,7 %
91-180	6,4 %	6,0 %
>180	6,9 %	6,8 %
Total	6,1 %	6,1 %

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	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	12	93	313	311	12	49	351	299
Real	53	5	134	154	90	10	108	110	48	12	98	149
Total	59	59	526	526	103	103	421	421	60	60	449	449

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

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