

Fecha de publicación: 11 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 9 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\$127,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	34,0	30,1	0,1	4,0	34,2
15-35	43,2	43,0	12,9	13,0	56,0
36-60	0,2	2,1	1,9	-	2,1
61-90	0,1	6,0	5,9	-	6,0
91-180	16,3	13,3	7,3	10,3	23,5
>180	5,0	4,6	0,6	1,0	5,6
Total	98,7	99,1	28,7	28,3	127,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	9 al 13 de Agosto				16 al 20 de Agosto				23 al 27 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	12	93	321	319	12	49	377	321	7	70	249	217
Real	91	10	108	110	48	12	98	153	66	3	78	111
Total	103	103	429	429	60	60	475	475	73	73	327	327

* 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 10 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.