

Fecha de publicación: 12 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 10 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\$273,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	27,0	34,7	15,4	7,7	42,5
15-35	62,4	49,5	8,5	21,4	70,9
36-60	7,6	7,0	3,3	4,0	11,0
61-90	14,1	15,0	1,0	0,1	15,1
91-180	10,0	16,4	8,4	2,0	18,4
>180	86,0	35,4	29,4	80,0	115,4
Total	207,2	158,0	66,0	115,2	273,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	330	328	13	48	392	336	7	70	251	228
Real	91	10	108	110	48	12	103	158	66	3	89	113
Total	103	103	438	438	61	61	495	495	73	73	340	340

* 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 11 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.