

Fecha de publicación: 13 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 11 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\$216,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	88,9	106,3	31,3	13,9	120,2
15-35	73,0	54,5	0,2	18,7	73,2
36-60	10,1	10,6	0,6	0,1	10,7
61-90	0,1	0,4	0,4	0,1	0,4
91-180	5,2	1,7	1,7	5,2	6,9
>180	1,5	4,7	3,2	-	4,7
Total	178,7	178,2	37,4	38,0	216,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	330	328	14	64	464	400	9	86	273	247
Real	91	10	108	110	63	13	103	166	82	5	89	116
Total	103	103	438	438	77	77	567	567	91	91	362	362

* 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 12 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.