

Fecha de publicación: 17 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 12 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\$218,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	69,2	47,5	16,0	37,7	85,2
15-35	47,4	48,7	20,9	19,6	68,3
36-60	6,0	1,4	1,4	6,0	7,4
61-90	25,7	39,5	15,3	1,5	41,0
91-180	10,4	8,3	2,9	5,0	13,3
>180	1,9	0,9	0,9	1,9	2,8
Total	160,5	146,3	57,5	71,7	218,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	17	66	489	425	10	91	324	264
Real	91	10	108	110	66	16	109	173	87	7	91	151
Total	103	103	438	438	82	82	598	598	97	97	415	415

* 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 13 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.