

Fecha de publicación: 19 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 17 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\$123,6 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	27,3	19,5	0,3	8,1	27,6
15-35	23,1	62,3	44,9	5,7	68,0
36-60	7,5	10,7	3,2	-	10,7
61-90	3,0	0,0	0,0	3,0	3,0
91-180	5,0	7,2	7,2	5,0	12,2
>180	-	2,2	2,2	-	2,2
Total	65,8	101,9	57,8	21,7	123,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,2 %	5,0 %
15-35	3,5 %	3,1 %
36-60	5,0 %	4,0 %
61-90	6,1 %	5,3 %
91-180	6,7 %	5,9 %
>180	6,7 %	6,2 %
Total	5,0 %	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	16 al 20 de Agosto				23 al 27 de Agosto				30 de Ago. al 3 de Sep			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	37	67	524	485	11	93	345	272	5	62	370	363
Real	66	36	129	168	89	7	92	164	61	4	99	106
Total	103	103	653	653	100	100	437	437	66	66	469	469

* 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 18 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.