

Fecha de publicación: 20 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 18 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\$162,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	27,3	17,0	-	10,3	27,3
15-35	80,4	78,4	30,9	32,9	111,3
36-60	1,3	3,3	2,0	-	3,3
61-90	11,5	12,4	0,9	-	12,4
91-180	4,1	3,7	2,6	3,0	6,7
>180	0,2	1,6	1,5	-	1,6
Total	124,8	116,5	37,9	46,2	162,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,6 %	4,3 %
15-35	4,2 %	4,3 %
36-60	5,1 %	4,9 %
61-90	5,4 %	5,0 %
91-180	6,2 %	6,1 %
>180	7,1 %	7,1 %
Total	4,9 %	4,5 %

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	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	371	288	5	62	401	378
Real	66	36	129	168	89	7	92	174	61	5	104	127
Total	103	103	653	653	100	100	463	463	66	66	505	505

* 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 19 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.