

Fecha de publicación: 23 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 19 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\$93,3 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	20,5	11,5	0,5	9,5	21,0
15-35	20,6	32,7	27,7	15,6	48,4
36-60	0,7	2,6	2,1	0,2	2,8
61-90	6,5	9,0	2,5	0,1	9,0
91-180	-	8,2	8,2	-	8,2
>180	0,3	3,9	3,6	-	3,9
Total	48,7	67,9	44,6	25,4	93,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,1 %	3,7 %
15-35	4,6 %	4,5 %
36-60	5,3 %	5,3 %
61-90	5,4 %	5,1 %
91-180	6,3 %	6,0 %
>180	6,8 %	6,5 %
Total	4,9 %	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	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	388	299	6	62	404	379
Real	66	36	129	168	89	8	92	180	61	5	105	130
Total	103	103	653	653	100	100	480	480	67	67	509	509

* 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 20 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.