

Fecha de publicación: 24 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 20 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\$112,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6,2	31,3	31,0	5,9	37,2
15-35	41,7	23,7	2,5	20,6	44,2
36-60	5,0	7,4	2,4	-	7,4
61-90	15,0	16,1	1,1	-	16,1
91-180	-	3,5	3,5	-	3,5
>180	-	4,0	4,0	-	4,0
Total	67,9	86,0	44,5	26,4	112,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8,9 %	6,5 %
15-35	4,2 %	4,3 %
36-60	4,8 %	4,9 %
61-90	6,1 %	6,0 %
91-180	6,6 %	6,3 %
>180	6,6 %	6,4 %
Total	6,4 %	5,4 %

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	113	388	300	7	72	409	379
Real	66	36	129	168	109	8	92	180	71	6	105	135
Total	103	103	653	653	120	120	480	480	78	78	514	514

* 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 23 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.