

Fecha de publicación: 27 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 25 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\$295,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	55,2	25,7	4,8	34,3	60,0
15-35	198,2	73,7	19,7	144,2	217,9
36-60	-	0,9	0,9	-	0,9
61-90	7,5	9,5	2,0	-	9,5
91-180	0,3	2,9	2,9	0,3	3,1
>180	-	3,9	3,9	-	3,9
Total	261,2	116,6	34,1	178,7	295,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	23 al 27 de Agosto				30 de Ago. al 3 de Septiembre				6 al 10 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	14	112	393	305	9	81	464	422	11	48	507	343
Real	108	11	93	180	79	8	107	150	45	8	50	214
Total	123	123	486	486	88	88	572	572	56	56	557	557

* 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 26 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.