

Fecha de publicación: 31 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 27 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\$184,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14,9	11,0	8,0	11,9	22,8
15-35	76,6	47,2	26,7	56,1	103,3
36-60	17,0	26,6	19,6	10,0	36,6
61-90	5,0	3,1	1,1	3,0	6,1
91-180	9,1	8,0	2,0	3,1	11,1
>180	-	4,1	4,1	-	4,1
Total	122,5	100,1	61,6	84,0	184,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,4 %	-0,4 %
15-35	4,2 %	4,1 %
36-60	4,0 %	3,2 %
61-90	5,7 %	5,3 %
91-180	5,7 %	5,6 %
>180	6,8 %	6,9 %
Total	4,5 %	3,6 %

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	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	12	90	468	431	12	89	558	363
Real	108	11	93	180	88	10	113	150	86	9	55	251
Total	123	123	486	486	100	100	580	580	98	98	614	614

* 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 30 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.