

Fecha de publicación: 9 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 5 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\$95,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	10,6	7,5	0,0	3,1	10,6
15-35	36,4	43,2	11,7	4,9	48,0
36-60	11,2	13,1	1,9	-	13,1
61-90	1,5	0,7	0,7	1,5	2,2
91-180	-	2,7	2,7	-	2,7
>180	-	18,5	18,5	-	18,5
Total	59,6	85,8	35,5	9,4	95,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	2 al 6 de Agosto				9 al 13 de Agosto				16 al 20 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	6	54	392	371	10	92	297	306	11	49	326	276
Real	53	5	134	154	90	8	103	94	48	11	98	147
Total	59	59	526	526	101	101	400	400	59	59	424	424

* 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 6 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.