

Fecha de publicación: 6 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 4 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\$172,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	16,2	25,5	15,5	6,2	31,6
15-35	36,3	35,6	22,1	22,8	58,3
36-60	-	0,3	0,3	-	0,3
61-90	13,0	7,3	0,3	6,0	13,3
91-180	17,5	7,3	0,3	10,5	17,8
>180	39,1	39,2	12,2	12,1	51,3
Total	122,1	115,1	50,6	57,6	172,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	9	92	290	299	11	49	319	271
Real	53	5	134	154	90	7	103	94	48	10	98	145
Total	59	59	526	526	99	99	393	393	59	59	417	417

* 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 5 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.