

Fecha de publicación: 7 de Julio de 2004
 Fecha de Información: 2 de Julio 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\$161,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	51,5	53,1	14,1	12,5	65,6
15-35	23,1	40,2	21,0	3,9	44,1
36-60	13,7	17,6	3,9	-	17,6
61-90	16,0	7,2	7,2	16,0	23,2
91-180	0,2	6,1	6,0	-	6,1
>180	1,0	4,6	3,6	-	4,6
Total	105,5	128,8	55,7	32,4	161,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	28 de Jun. al 2 de Julio				5 al 9 de Julio				12 al 16 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	83	89	492	440	26	58	369	241	18	41	392	327
Real	76	71	115	167	46	14	44	172	32	9	81	146
Total	160	160	607	607	72	72	414	414	50	50	473	473

* 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 julio se presenta la proyección de vencimientos.