

Fecha de publicación: 9 de Julio de 2004
Fecha de Información: 7 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\$100,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	41,4	26,0	4,0	19,4	45,4
15-35	29,7	50,1	21,6	1,2	51,3
36-60	-	0,3	0,3	-	0,3
61-90	2,0	-	-	2,0	2,0
91-180	-	0,7	0,7	-	0,7
>180	-	0,4	0,4	-	0,4
Total	73,1	77,5	27,0	22,6	100,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	5 al 9 de Julio				12 al 16 de Julio				19 al 23 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	26	58	369	241	18	45	410	346	2	13	332	199
Real	46	14	44	172	36	9	86	149	13	2	52	185
Total	72	72	414	414	54	54	496	496	15	15	384	384

* 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 8 de julio se presenta la proyección de vencimientos.