

Fecha de publicación: 12 de Julio de 2004
 Fecha de Información: 8 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\$126,7 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	45,9	29,0	2,0	18,9	47,9
15-35	20,4	56,4	36,4	0,4	56,7
36-60	1,0	2,1	2,1	1,0	3,1
61-90	5,5	10,6	5,1	-	10,6
91-180	1,5	2,2	0,6	-	2,2
>180	5,8	0,4	0,4	5,8	6,2
Total	80,1	100,7	46,6	26,1	126,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,8 %	3,9 %
15-35	3,1 %	2,8 %
36-60	3,6 %	3,2 %
61-90	5,0 %	4,8 %
91-180	6,0 %	5,8 %
>180	7,1 %	7,0 %
Total	3,5 %	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	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	19	45	454	373	3	13	332	201
Real	46	14	44	172	36	10	86	167	13	2	54	185
Total	72	72	414	414	55	55	540	540	16	16	386	386

* 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 9 de julio se presenta la proyección de vencimientos.