

Fecha de publicación: 13 de Julio de 2004
 Fecha de Información: 9 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\$190,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	73,7	54,4	16,4	35,7	90,1
15-35	58,6	60,5	17,3	15,5	76,0
36-60	-	2,5	2,5	-	2,5
61-90	12,6	1,1	0,1	11,6	12,7
91-180	4,9	8,6	3,7	-	8,6
>180	0,2	0,9	0,7	-	0,9
Total	150,1	128,0	40,7	62,8	190,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,8 %	0,2 %
15-35	1,7 %	1,6 %
36-60	3,7 %	2,7 %
61-90	4,3 %	3,2 %
91-180	5,7 %	5,2 %
>180	6,5 %	6,6 %
Total	2,4 %	1,3 %

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	20	54	516	414	3	13	343	206
Real	46	14	44	172	45	11	93	196	13	3	54	191
Total	72	72	414	414	65	65	609	609	16	16	397	397

* 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 12 de julio se presenta la proyección de vencimientos.