

Fecha de publicación: 15 de Julio de 2004
 Fecha de Información: 13 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\$114,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	19,5	7,0	0,0	12,5	19,5
15-35	47,7	41,8	12,3	18,2	60,0
36-60	5,0	9,2	4,2	-	9,2
61-90	21,0	8,1	2,1	15,0	23,1
91-180	-	2,6	2,6	-	2,6
>180	-	-	-	-	-
Total	93,2	68,7	21,2	45,7	114,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	12 al 16 de Julio				19 al 23 de Julio				26 al 30 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	20	54	519	417	3	13	357	215	14	52	206	235
Real	45	11	93	196	13	3	55	197	41	3	107	78
Total	66	66	612	612	16	16	412	412	55	55	313	313

* 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 14 de julio se presenta la proyección de vencimientos.