

Fecha de publicación: 19 de Julio de 2004
 Fecha de Información: 15 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\$178,6 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	35,6	26,9	1,4	10,1	37,0
15-35	35,5	72,3	47,8	11,0	83,3
36-60	5,0	17,5	12,5	-	17,5
61-90	16,1	12,6	7,5	11,0	23,6
91-180	0,1	10,3	10,2	-	10,3
>180	3,0	3,8	3,8	3,0	6,8
Total	95,3	143,4	83,2	35,1	178,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,2 %	6,4 %
15-35	2,0 %	1,6 %
36-60	4,2 %	4,0 %
61-90	4,7 %	4,4 %
91-180	5,9 %	5,8 %
>180	6,2 %	6,4 %
Total	4,3 %	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	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	6	35	420	262	18	66	249	268
Real	45	11	93	196	31	3	55	213	52	3	107	89
Total	66	66	612	612	38	38	475	475	69	69	356	356

* 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 16 de julio se presenta la proyección de vencimientos.