

Fecha de publicación: 21 de Julio de 2004
 Fecha de Información: 16 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\$315,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	65,7	47,6	33,6	51,7	99,3
15-35	96,3	63,7	11,7	44,3	108,0
36-60	21,0	49,8	28,8	-	49,8
61-90	7,0	29,7	22,7	-	29,7
91-180	0,3	12,4	12,1	-	12,4
>180	4,0	14,3	11,8	1,5	15,8
Total	194,3	217,5	120,7	97,5	315,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	13,3 %	3,4 %
15-35	3,5 %	3,4 %
36-60	4,6 %	4,2 %
61-90	4,9 %	4,4 %
91-180	5,7 %	5,7 %
>180	6,7 %	6,5 %
Total	6,4 %	3,9 %

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	13	57	445	277	18	66	283	278
Real	45	11	93	196	48	4	61	229	52	4	117	123
Total	66	66	612	612	61	61	507	507	70	70	400	400

* 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 19 de julio se presenta la proyección de vencimientos.