

Fecha de publicación: 22 de Julio de 2004
 Fecha de Información: 19 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\$110,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13,7	17,0	11,0	7,7	24,7
15-35	17,7	21,4	4,1	0,5	21,8
36-60	33,3	25,1	2,1	10,3	35,4
61-90	10,0	13,9	3,9	-	13,9
91-180	-	4,1	4,1	-	4,1
>180	10,3	-	-	10,3	10,3
Total	85,0	81,5	25,2	28,7	110,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	19 al 23 de Julio				26 al 30 de Julio				2 al 6 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	16	57	447	279	18	66	291	283	2	52	188	171
Real	48	8	62	230	52	4	117	125	50	1	69	86
Total	65	65	510	510	70	70	408	408	52	52	257	257

* 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 20 de julio se presenta la proyección de vencimientos.