

Fecha de publicación: 26 de Julio de 2004
 Fecha de Información: 22 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\$218,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	90,8	74,2	6,2	22,8	96,9
15-35	41,2	70,2	33,1	4,0	74,2
36-60	5,5	10,7	5,2	-	10,7
61-90	3,0	5,1	2,1	-	5,1
91-180	3,0	7,0	4,0	-	7,0
>180	5,3	19,0	19,0	5,3	24,3
Total	148,7	186,2	69,5	32,1	218,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	21	69	360	320	2	52	246	228
Real	48	8	62	230	52	5	121	161	50	1	74	92
Total	65	65	510	510	73	73	481	481	53	53	320	320

* 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 23 de julio se presenta la proyección de vencimientos.