

Fecha de publicación: 28 de Julio de 2004
 Fecha de Información: 26 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\$145,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	46,7	38,0	0,0	8,7	46,7
15-35	59,9	29,6	1,6	31,9	61,5
36-60	16,0	12,6	1,6	5,0	17,6
61-90	8,7	8,5	-	0,2	8,7
91-180	5,0	5,8	0,8	-	5,8
>180	4,9	2,0	-	2,9	4,9
Total	141,1	96,5	4,0	48,6	145,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	26 al 30 de Julio				2 al 6 de Agosto				9 al 13 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	22	69	378	338	4	52	314	267	6	88	216	213
Real	53	6	122	162	50	3	79	126	86	4	74	77
Total	75	75	500	500	55	55	394	394	92	92	290	290

* 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 27 de julio se presenta la proyección de vencimientos.