

Fecha de publicación: 2 de Agosto de 2004
 Fecha de Información: 29 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\$180,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	32,5	25,6	18,0	24,9	50,5
15-35	61,1	70,0	23,2	14,3	84,3
36-60	3,0	21,1	18,1	-	21,1
61-90	3,1	1,3	1,3	3,1	4,4
91-180	-	15,4	15,4	-	15,4
>180	-	5,0	5,0	-	5,0
Total	99,7	138,5	81,1	42,3	180,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,9 %	-1,1 %
15-35	4,0 %	3,7 %
36-60	5,7 %	5,1 %
61-90	5,6 %	5,5 %
91-180	6,1 %	5,9 %
>180	6,4 %	6,6 %
Total	4,8 %	2,9 %

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	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	31	69	382	338	6	52	358	332	7	92	246	258
Real	53	15	122	165	51	4	126	152	90	5	93	81
Total	84	84	503	503	57	57	484	484	97	97	339	339

* 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 30 de julio se presenta la proyección de vencimientos.