Fecha de publicación: 1 de Julio de 2004
Fecha de Información: 29 de Junio 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$101,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,9%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	26,7	1,4	1,4	26,7	28,2
15-35	32,0	32,0	14,0	14,0	46,0
36-60	2,0	12,8	10,8	-	12,8
61-90	2,0	2,0	-	-	2,0
91-180	3,8	4,2	0,4	-	4,2
>180	8,0	0,2	0,2	8,0	8,2
Total	**74,5**	**52,6**	**26,8**	**48,7**	**101,3**

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	28 de Jun. al 2 de Julio				5 al 9 de Julio				12 al 16 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	83	89	492	440	14	46	266	158	15	40	317	274
Real	76	71	115	167	45	13	33	142	31	6	76	118
Total	160	160	607	607	59	59	299	299	46	46	392	392

* 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 30 de junio se presenta la proyección de vencimientos.