

Fecha de publicación: 2 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 31 de Agosto 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\$186,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	15,8	18,7	3,5	0,6	19,3
15-35	49,0	103,6	90,6	36,0	139,6
36-60	0,0	19,7	19,7	0,0	19,8
61-90	0,9	1,2	0,5	0,3	1,5
91-180	0,3	4,2	3,9	0,1	4,3
>180	-	2,4	2,4	-	2,4
Total	66,0	149,9	120,8	36,9	186,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sectores	30 de Ago. al 3 de Sept				6 al 10 de Sept				13 al 17 de Sept			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	27	105	472	435	13	89	583	382	17	179	308	144
Real	88	10	113	150	86	9	59	260	168	6	46	210
Total	115	115	585	585	99	99	642	642	185	185	354	354

* 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 1 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.