

Fecha de publicación: 3 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 1 de Septiembre 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\$203,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	43,2	38,5	5,5	10,2	48,8
15-35	74,3	85,4	44,4	33,3	118,6
36-60	0,3	7,7	7,6	0,2	7,9
61-90	2,0	16,1	14,5	0,4	16,6
91-180	8,8	4,7	1,6	5,7	10,5
>180	-	1,4	1,4	-	1,4
Total	128,7	153,8	75,0	49,9	203,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	19	94	603	402	20	179	327	161
Real	88	10	113	150	86	10	59	260	168	8	51	217
Total	115	115	585	585	105	105	662	662	187	187	378	378

* 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 2 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.