

Fecha de publicación: 6 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 2 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\$311,1 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	44,9	18,1	13,1	39,9	58,0
15-35	162,3	119,7	31,7	74,3	194,0
36-60	0,3	5,2	5,1	0,2	5,4
61-90	19,3	36,1	16,8	-	36,1
91-180	4,7	4,5	4,3	4,5	9,0
>180	5,0	8,5	3,5	-	8,5
Total	236,5	192,2	74,6	118,9	311,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	26	94	625	417	20	179	358	180
Real	88	10	113	150	86	17	69	277	168	9	65	243
Total	115	115	585	585	111	111	694	694	188	188	422	422

* 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 3 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.