

Fecha de publicación: 7 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 3 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\$198,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,9\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	65,4	39,3	8,3	34,4	73,7
15-35	54,6	58,4	40,6	36,8	95,3
36-60	2,7	1,4	0,8	2,0	3,4
61-90	0,6	1,4	0,8	0,0	1,4
91-180	0,5	12,9	12,4	-	12,9
>180	7,0	5,2	5,2	7,0	12,2
Total	130,7	118,6	68,1	80,3	198,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	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	43	109	647	434	28	179	376	187
Real	88	10	113	150	86	19	75	288	168	17	67	256
Total	115	115	585	585	129	129	722	722	196	196	443	443

* 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 6 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.