

Fecha de publicación: 8 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 6 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\$93,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	30,3	23,0	3,0	10,3	33,3
15-35	42,9	33,1	3,1	12,9	45,9
36-60	7,5	7,0	-	0,5	7,5
61-90	0,2	0,3	0,3	0,2	0,5
91-180	5,3	5,8	0,8	0,3	6,1
>180	-	0,1	0,1	-	0,1
Total	86,1	69,3	7,3	24,1	93,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	6 al 10 de Septiembre				13 al 17 de Septiembre				20 al 24 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	50	116	660	442	28	179	386	192	8	77	392	321
Real	86	20	75	293	168	17	67	261	75	7	35	106
Total	136	136	735	735	196	196	453	453	83	83	427	427

* 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 7 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.