

Fecha de publicación: 10 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 8 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\$275,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	43,5	46,0	32,0	29,4	75,5
15-35	93,9	69,3	36,8	61,3	130,7
36-60	7,1	5,2	5,1	7,0	12,2
61-90	27,1	11,5	2,5	18,1	29,6
91-180	9,8	12,0	9,0	6,8	18,8
>180	0,2	8,9	8,7	-	8,9
Total	181,5	153,0	94,1	122,6	275,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,8 %	-1,0 %
15-35	2,8 %	2,6 %
36-60	4,1 %	3,7 %
61-90	5,3 %	3,9 %
91-180	6,1 %	5,5 %
>180	6,4 %	6,5 %
Total	4,1 %	2,1 %

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

Sector	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	65	131	663	450	34	211	530	269	10	104	427	343
Real	86	20	80	293	200	23	67	327	102	7	35	119
Total	151	151	743	743	234	234	596	596	111	111	462	462

* 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 9 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.