

Fecha de publicación: 13 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 9 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\$358,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	116,6	56,6	9,6	69,6	126,2
15-35	108,9	85,0	52,0	75,9	160,9
36-60	48,8	7,8	0,7	41,7	49,5
61-90	0,0	0,6	0,6	0,0	0,7
91-180	4,1	5,7	4,1	2,5	8,2
>180	6,0	7,2	7,2	6,0	13,2
Total	284,4	162,9	74,3	195,8	358,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	65	131	663	451	39	211	628	312	10	107	471	353
Real	85	19	81	293	198	25	74	390	105	7	36	153
Total	150	150	744	744	237	237	702	702	115	115	507	507

* 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 10 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.