

Fecha de publicación: 14 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 10 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\$241,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,2	78,6	53,6	19,2	97,8
15-35	57,5	65,2	23,7	16,0	81,2
36-60	22,8	9,0	-	13,8	22,8
61-90	28,4	28,9	0,9	0,4	29,3
91-180	8,0	4,8	1,3	4,5	9,3
>180	0,0	0,9	0,9	0,0	0,9
Total	161,0	187,5	80,4	54,0	241,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	40	231	658	337	11	116	482	378
Real	85	19	81	293	218	27	74	395	113	8	61	164
Total	150	150	744	744	258	258	732	732	124	124	543	543

* 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 13 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.