

Fecha de publicación: 15 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 13 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\$275,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	68,3	79,4	15,4	4,3	83,7
15-35	64,5	90,2	77,6	51,9	142,1
36-60	21,1	3,4	3,4	21,1	24,4
61-90	-	1,8	1,8	-	1,8
91-180	2,3	9,8	7,4	-	9,8
>180	12,8	0,8	0,8	12,8	13,6
Total	168,9	185,4	106,5	90,0	275,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	13 al 17 de Septiembre				20 al 24 de Septiembre				27 de Sep. al 1 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	40	247	698	377	12	116	502	398	5	161	432	362
Real	233	27	74	395	113	9	61	164	160	4	185	254
Total	273	273	773	773	125	125	563	563	165	165	617	617

* 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 14 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.