

Fecha de publicación: 16 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 14 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\$179,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	35,5	21,1	2,0	16,4	37,5
15-35	25,9	48,9	25,9	2,9	51,8
36-60	46,0	20,6	0,6	26,0	46,6
61-90	15,1	18,4	3,4	0,1	18,5
91-180	13,0	4,6	1,6	10,0	14,6
>180	8,0	2,3	2,3	8,0	10,3
Total	143,5	115,9	35,8	63,4	179,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	44	247	707	378	13	116	523	415	5	174	441	372
Real	233	31	74	403	113	10	61	168	173	4	187	255
Total	277	277	782	782	126	126	584	584	179	179	628	628

* 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 15 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.