

Fecha de publicación: 20 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 16 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\$345,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	71,3	58,3	15,8	28,8	87,1
15-35	146,6	138,7	61,0	68,9	207,5
36-60	13,0	0,1	0,1	13,0	13,1
61-90	15,5	23,0	8,0	0,5	23,5
91-180	2,0	3,5	1,5	-	3,5
>180	10,0	0,3	0,3	10,0	10,3
Total	258,4	223,8	86,6	121,2	345,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	21	124	599	478	6	176	504	438
Real	233	31	74	403	121	19	82	203	175	5	206	272
Total	277	277	782	782	142	142	681	681	181	181	710	710

* 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 17 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.