

Fecha de publicación: 23 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 21 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\$229,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	31,3	59,5	39,6	11,4	70,9
15-35	63,1	112,8	57,8	8,1	120,9
36-60	25,4	26,0	1,0	0,4	26,4
61-90	5,1	5,1	0,1	0,1	5,1
91-180	0,2	0,5	0,5	0,1	0,6
>180	-	5,4	5,4	-	5,4
Total	125,0	209,3	104,3	20,0	229,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	20 al 24 de Septiembre				27 de Sep. al 1 de Octubre				4 al 8 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	28	129	627	525	14	178	598	550	7	83	531	450
Real	126	24	108	210	177	13	229	278	80	4	175	256
Total	154	154	735	735	191	191	827	827	87	87	706	706

* 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 22 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.