

Fecha de publicación: 24 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 22 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\$181,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	53,5	50,7	10,3	13,1	63,8
15-35	59,1	59,0	11,5	11,6	70,5
36-60	9,0	9,1	0,1	0,0	9,1
61-90	19,0	23,1	4,1	0,0	23,1
91-180	0,0	0,9	0,9	0,0	0,9
>180	10,1	6,1	4,1	8,1	14,2
Total	150,7	148,7	30,8	32,8	181,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	635	581	13	97	551	471
Real	126	24	108	210	177	14	235	289	90	5	179	259
Total	154	154	735	735	192	192	870	870	102	102	730	730

* 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 23 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.