

Fecha de publicación: 27 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 23 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\$299,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	49,6	76,8	50,0	22,9	99,6
15-35	89,0	116,2	58,2	31,0	147,2
36-60	17,2	17,2	-	-	17,2
61-90	1,1	2,6	1,6	-	2,6
91-180	27,0	12,6	5,6	20,0	32,6
>180	0,3	-	-	0,3	0,3
Total	184,2	225,4	115,4	74,1	299,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	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	23	199	667	611	16	101	557	495
Real	126	24	108	210	193	17	249	305	93	8	198	260
Total	154	154	735	735	216	216	916	916	109	109	755	755

* 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 24 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.