

Fecha de publicación: 28 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 24 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\$364,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	39,6	34,1	23,1	28,6	62,7
15-35	139,8	174,4	106,9	72,4	246,7
36-60	0,2	2,5	2,5	0,2	2,6
61-90	17,1	3,8	0,8	14,1	17,9
91-180	0,2	0,3	0,3	0,2	0,5
>180	24,0	10,0	10,0	24,0	34,0
Total	221,0	225,0	143,6	139,5	364,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,9 %	10,1 %
15-35	4,2 %	5,5 %
36-60	3,0 %	1,6 %
61-90	3,9 %	3,6 %
91-180	2,3 %	4,7 %
>180	4,2 %	5,7 %
Total	2,4 %	6,2 %

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	28	199	679	630	17	101	579	510
Real	126	24	108	210	193	22	262	311	93	10	208	276
Total	154	154	735	735	221	221	941	941	110	110	786	786

* 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 27 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.