

Fecha de publicación: 30 de Septiembre de 2004
 Fecha de Información: 28 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\$219,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|-------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 104,9 | 119,3 | 19,3 | 4,9 | 124,2 |
| 15-35 | 63,8 | 41,0 | 9,0 | 31,8 | 72,8 |
| 36-60 | - | 4,3 | 4,3 | - | 4,3 |
| 61-90 | 7,4 | 8,6 | 2,6 | 1,4 | 10,1 |
| 91-180 | - | 0,2 | 0,2 | - | 0,2 |
| >180 | 4,1 | 6,7 | 3,7 | 1,1 | 7,8 |
| Total | 180,2 | 180,3 | 39,3 | 39,2 | 219,5 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 3,0 % | 2,8 % |
| 15-35 | 2,4 % | 2,2 % |
| 36-60 | 4,2 % | 3,9 % |
| 61-90 | 4,4 % | 4,7 % |
| 91-180 | 5,5 % | 5,5 % |
| >180 | 5,9 % | 6,0 % |
| Total | 3,3 % | 2,8 % |

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 | 27 de Sep. al 1 de Octubre | | | | 4 al 8 de Octubre | | | | 11 al 15 de Octubre | | | |
|-------------------|----------------------------|-----|-----|-----|-------------------|-----|-----|-----|---------------------|-----|-----|-----|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Financiero | 28 | 199 | 733 | 665 | 19 | 101 | 643 | 572 | 22 | 202 | 495 | 416 |
| Real | 193 | 22 | 262 | 329 | 93 | 11 | 210 | 281 | 196 | 16 | 154 | 233 |
| Total | 221 | 221 | 995 | 995 | 112 | 112 | 853 | 853 | 218 | 218 | 650 | 650 |

* 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 29 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.