

Fecha de publicación: 1 de Octubre de 2004
 Fecha de Información: 29 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\$234,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	53,6	94,7	52,2	11,1	105,8
15-35	65,1	72,0	27,0	20,1	92,1
36-60	0,1	1,9	1,9	0,1	2,0
61-90	18,3	14,5	4,5	8,3	22,8
91-180	-	1,7	1,7	-	1,7
>180	-	10,1	10,1	-	10,1
Total	137,1	195,0	97,5	39,6	234,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,6 %	4,1 %
15-35	2,9 %	2,9 %
36-60	3,2 %	4,0 %
61-90	4,3 %	3,9 %
91-180	5,6 %	5,5 %
>180	5,7 %	5,8 %
Total	4,2 %	3,7 %

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	111	692	623	22	224	499	433
Real	193	22	262	329	104	12	222	291	218	16	166	233
Total	221	221	995	995	123	123	914	914	240	240	666	666

* 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 30 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.