

Fecha de publicación: 7 de Octubre de 2004
 Fecha de Información: 5 de Octubre 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\$276,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	70,2	75,9	22,6	16,9	92,9
15-35	57,8	65,6	31,0	23,2	88,8
36-60	1,6	2,7	1,2	0,1	2,8
61-90	11,0	12,6	1,6	-	12,6
91-180	72,5	29,1	6,6	50,0	79,1
>180	0,0	0,7	0,7	0,0	0,7
Total	213,2	186,6	63,7	90,2	276,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	13,7 %	25,4 %
15-35	3,1 %	2,8 %
36-60	3,3 %	4,2 %
61-90	4,3 %	4,0 %
91-180	4,9 %	4,0 %
>180	5,8 %	6,4 %
Total	6,6 %	10,8 %

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

Sectores	4 al 8 de Octubre				11 al 15 de Octubre				18 al 22 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	25	121	776	680	34	232	610	610	9	91	470	440
Real	113	17	234	330	226	28	243	243	90	8	132	162
Total	137	137	1010	1010	260	260	853	853	99	99	602	602

* 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 6 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.