

Fecha de publicación: 8 de Octubre de 2004
 Fecha de Información: 6 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\$252,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	62,0	61,3	17,3	18,0	79,2
15-35	84,8	124,5	77,5	37,8	162,3
36-60	6,2	8,8	2,7	0,1	8,9
61-90	0,5	0,0	0,0	0,5	0,5
91-180	0,2	1,9	1,6	-	1,9
>180	-	0,1	0,1	-	0,1
Total	153,7	196,5	99,2	56,3	252,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	47	232	636	647	9	92	514	484
Real	113	17	234	330	226	41	260	249	91	8	132	163
Total	137	137	1010	1010	272	272	896	896	100	100	646	646

* 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 7 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.