

Fecha de publicación: 11 de Octubre de 2004
 Fecha de Información: 7 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\$186,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	25,5	27,4	5,4	3,5	30,9
15-35	101,9	99,0	39,0	41,9	140,9
36-60	5,1	5,4	0,3	-	5,4
61-90	-	0,2	0,2	-	0,2
91-180	8,0	8,6	0,6	-	8,6
>180	-	-	-	-	-
Total	140,5	140,6	45,5	45,4	186,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	50	235	642	655	9	95	531	499
Real	113	17	234	330	226	42	264	252	94	8	133	165
Total	137	137	1010	1010	276	276	907	907	103	103	664	664

* 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 8 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.