

Fecha de publicación: 14 de Octubre de 2004
 Fecha de Información: 12 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\$353,7 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	68,0	81,7	32,7	19,0	100,7
15-35	100,7	143,5	59,9	17,0	160,5
36-60	7,0	12,3	10,3	5,0	17,3
61-90	-	11,4	11,4	-	11,4
91-180	43,0	21,5	13,5	35,0	56,5
>180	-	7,3	7,3	-	7,3
Total	218,6	277,7	135,0	76,0	353,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,7 %	1,8 %
15-35	3,8 %	3,2 %
36-60	3,9 %	3,7 %
61-90	4,5 %	4,7 %
91-180	4,8 %	3,8 %
>180	6,0 %	5,8 %
Total	4,1 %	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	11 al 15 de Octubre				18 al 22 de Octubre				25 al 29 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	56	236	713	735	10	119	614	556	9	106	540	555
Real	227	47	276	254	118	9	144	202	100	3	228	213
Total	283	283	989	989	128	128	758	758	109	109	768	768

* 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 13 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.