

Fecha de publicación: 19 de Octubre de 2004
 Fecha de Información: 14 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\$280,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	65,4	68,7	17,7	14,4	83,1
15-35	67,2	93,6	52,6	26,2	119,8
36-60	12,0	20,5	8,5	0,0	20,5
61-90	20,1	31,5	11,5	0,1	31,6
91-180	10,1	25,0	14,8	-	25,0
>180	0,1	0,9	0,9	0,1	0,9
Total	174,9	240,1	106,0	40,8	280,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	29	134	731	645	10	143	609	626
Real	226	47	276	254	118	13	156	241	138	5	240	224
Total	283	283	989	989	147	147	886	886	148	148	849	849

* 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 15 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.