

Fecha de publicación: 20 de Octubre de 2004
 Fecha de Información: 15 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\$388,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	116,1	171,9	98,9	43,1	215,1
15-35	86,7	68,0	18,0	36,7	104,7
36-60	8,8	9,3	9,2	8,7	18,0
61-90	5,5	5,3	5,3	5,5	10,8
91-180	2,2	4,3	2,2	-	4,3
>180	35,1	5,1	0,1	30,0	35,1
Total	254,3	264,0	133,7	124,1	388,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	12,1 %	0,3 %
15-35	3,9 %	3,7 %
36-60	4,2 %	3,5 %
61-90	4,3 %	4,2 %
91-180	6,3 %	6,1 %
>180	6,6 %	6,0 %
Total	8,1 %	2,1 %

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	36	141	816	746	18	155	626	679
Real	226	47	276	254	120	15	197	266	144	7	290	237
Total	283	283	989	989	156	156	1013	1013	161	161	916	916

* 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 18 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.