

Fecha de publicación: 21 de Octubre de 2004
 Fecha de Información: 19 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\$264,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	85,9	107,5	36,5	14,9	122,4
15-35	89,8	95,2	34,2	28,8	124,0
36-60	0,0	5,4	5,4	0,0	5,4
61-90	2,0	5,7	3,7	-	5,7
91-180	0,0	1,1	1,1	-	1,1
>180	4,8	4,0	1,0	1,8	5,8
Total	182,5	219,0	81,9	45,5	264,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	18 al 22 de Octubre				25 al 29 de Octubre				1 al 5 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	56	161	829	749	30	181	654	725	3	59	696	564
Real	120	15	197	277	160	9	310	239	58	1	164	296
Total	176	176	1026	1026	189	189	964	964	61	61	860	860

* 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 20 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.