

Fecha de publicación: 25 de Octubre de 2004
 Fecha de Información: 21 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\$235,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	94,6	93,4	26,9	28,1	121,5
15-35	82,0	85,2	19,7	16,5	101,7
36-60	3,0	3,3	0,3	0,0	3,3
61-90	-	2,4	2,4	-	2,4
91-180	0,2	0,7	0,5	-	0,7
>180	2,0	4,0	4,0	2,0	6,0
Total	181,8	189,1	53,9	46,6	235,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	36	181	782	858	14	78	748	625
Real	120	15	197	277	160	15	330	254	66	3	192	315
Total	176	176	1026	1026	196	196	1112	1112	81	81	940	940

* 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 22 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.