

Fecha de publicación: 26 de Octubre de 2004
 Fecha de Información: 22 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\$183,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	60,5	67,6	15,6	8,5	76,1
15-35	64,5	57,0	8,0	15,5	72,5
36-60	3,5	2,2	0,2	1,5	3,7
61-90	0,3	1,4	1,1	-	1,4
91-180	7,0	1,0	0,9	6,9	7,9
>180	20,0	1,8	1,8	20,0	21,8
Total	155,8	131,0	27,6	52,4	183,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.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	38	192	823	897	19	81	761	639
Real	120	15	197	277	171	17	330	256	69	7	194	315
Total	176	176	1026	1026	209	209	1153	1153	88	88	954	954

* 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 25 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.