

Fecha de publicación: 27 de Octubre de 2004
 Fecha de Información: 25 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\$326,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 83,2 | 25,1 | 0,1 | 58,2 | 83,3 |
| 15-35 | 118,1 | 137,7 | 46,5 | 27,0 | 164,6 |
| 36-60 | 4,1 | 4,0 | - | 0,1 | 4,1 |
| 61-90 | 0,3 | 1,9 | 1,9 | 0,3 | 2,3 |
| 91-180 | 0,1 | 60,4 | 60,4 | 0,1 | 60,5 |
| >180 | 12,0 | 6,0 | - | 6,0 | 12,0 |
| Total | 217,9 | 235,0 | 108,9 | 91,7 | 326,8 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | -4,3 % | -13,5 % |
| 15-35 | 3,5 % | 4,4 % |
| 36-60 | 5,5 % | 4,2 % |
| 61-90 | 4,0 % | 3,9 % |
| 91-180 | 5,7 % | 6,6 % |
| >180 | 6,1 % | 6,1 % |
| Total | 0,3 % | 0,3 % |

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 | 25 al 29 de Octubre | | | | 1 al 5 de Noviembre | | | | 8 al 12 de Noviembre | | | |
|-------------------|---------------------|-----|------|------|---------------------|----|-----|-----|----------------------|-----|-----|-----|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Financiero | 43 | 193 | 859 | 905 | 24 | 81 | 793 | 652 | 8 | 120 | 492 | 494 |
| Real | 171 | 21 | 331 | 284 | 69 | 13 | 194 | 334 | 119 | 6 | 147 | 144 |
| Total | 214 | 214 | 1190 | 1190 | 93 | 93 | 986 | 986 | 126 | 126 | 638 | 638 |

* 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 26 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.