

Fecha de publicación: 28 de Octubre de 2004
 Fecha de Información: 26 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\$173,1 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	38,9	22,5	2,0	18,4	40,9
15-35	80,6	54,3	14,7	41,0	95,3
36-60	15,5	0,0	0,0	15,5	15,5
61-90	2,0	3,4	1,4	-	3,4
91-180	2,1	4,1	4,1	2,1	6,2
>180	3,0	11,8	8,8	-	11,8
Total	142,1	96,1	31,0	77,0	173,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.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	188	884	917	25	81	802	658	9	120	524	522
Real	166	21	331	298	69	13	195	338	119	7	147	148
Total	209	209	1215	1215	94	94	997	997	128	128	670	670

* 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 27 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.