

Fecha de publicación: 29 de Octubre de 2004
 Fecha de Información: 27 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\$166,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	36,0	39,3	7,3	4,0	43,3
15-35	79,8	56,2	8,9	32,5	88,7
36-60	20,0	-	-	20,0	20,0
61-90	10,0	10,0	-	0,0	10,0
91-180	0,4	2,2	2,0	0,1	2,3
>180	1,0	1,7	0,7	-	1,7
Total	147,2	109,4	18,8	56,6	166,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	188	884	917	26	81	821	677	11	124	546	542
Real	166	21	331	298	69	14	195	338	122	9	154	157
Total	209	209	1215	1215	95	95	1016	1016	133	133	700	700

* 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 28 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.