

Fecha de publicación: 2 de Noviembre de 2004
 Fecha de Información: 28 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\$229,6 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	86,5	72,9	20,0	33,6	106,5
15-35	80,6	94,7	31,7	17,6	112,2
36-60	1,5	0,1	0,1	1,5	1,6
61-90	3,8	4,5	2,5	1,8	6,3
91-180	0,5	1,0	0,5	-	1,0
>180	1,0	2,0	1,0	-	2,0
Total	173,9	175,2	55,8	54,5	229,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,7 %	3,4 %
15-35	4,4 %	4,9 %
36-60	9,8 %	20,6 %
61-90	4,9 %	3,7 %
91-180	6,7 %	5,6 %
>180	8,1 %	5,6 %
Total	4,2 %	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	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	49	110	879	710	13	124	553	564
Real	166	21	331	298	79	18	195	364	122	11	174	164
Total	209	209	1215	1215	128	128	1074	1074	135	135	728	728

* 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 29 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.