

Fecha de publicación: 22 de Noviembre de 2004
 Fecha de Información: 18 de Noviembre 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\$237,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	72,0	80,5	15,3	6,8	87,3
15-35	42,2	73,3	56,4	25,3	98,6
36-60	19,0	10,2	1,2	10,0	20,2
61-90	10,0	1,9	1,8	10,0	11,9
91-180	8,0	1,7	1,6	8,0	9,7
>180	8,0	4,3	1,3	5,0	9,3
Total	159,3	171,9	77,7	65,0	237,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	15 al 19 de Noviembre				22 al 26 de Noviembre				29 de Nov. al 3 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	59	110	756	704	15	159	414	411	16	140	417	375
Real	101	50	128	179	157	13	128	131	129	5	77	119
Total	160	160	884	884	172	172	542	542	144	144	494	494

* 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 19 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.