

Fecha de publicación: 23 de Noviembre de 2004
 Fecha de Información: 19 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\$229,7 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	61,2	35,3	0,3	26,2	61,6
15-35	75,6	89,8	37,8	23,6	113,4
36-60	42,3	30,6	0,1	11,8	42,4
61-90	-	1,0	1,0	-	1,0
91-180	2,0	9,0	9,0	1,9	10,9
>180	-	0,4	0,4	-	0,4
Total	181,1	166,2	48,7	63,5	229,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	9,9 %	4,0 %
15-35	4,2 %	4,4 %
36-60	4,7 %	4,2 %
61-90	7,0 %	7,8 %
91-180	5,6 %	5,4 %
>180	5,4 %	5,4 %
Total	6,7 %	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	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	19	162	449	428	17	140	439	390
Real	101	50	128	179	157	14	128	149	129	6	77	125
Total	160	160	884	884	176	176	577	577	146	146	516	516

* 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 22 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.