

Fecha de publicación: 24 de Noviembre de 2004
 Fecha de Información: 22 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\$185,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	102,0	87,8	2,0	16,3	104,0
15-35	38,7	44,9	7,4	1,2	46,1
36-60	7,8	7,3	0,3	0,8	8,1
61-90	20,2	20,0	-	0,2	20,2
91-180	1,0	0,4	0,4	1,0	1,4
>180	5,0	5,3	0,3	-	5,3
Total	174,7	165,7	10,4	19,5	185,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	22 al 26 de Noviembre				29 de Nov. al 3 de Dic.				6 al 10 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	25	162	487	457	17	140	485	437	9	52	545	397
Real	157	19	128	158	129	6	79	127	49	5	110	258
Total	181	181	615	615	146	146	564	564	58	58	654	654

* 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 23 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.