

Fecha de publicación: 25 de Noviembre de 2004
 Fecha de Información: 23 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\$211,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	100,6	60,0	8,5	49,1	109,0
15-35	47,5	54,3	14,3	7,5	61,8
36-60	20,0	28,7	10,7	2,0	30,7
61-90	3,0	5,2	2,2	-	5,2
91-180	-	3,1	3,1	-	3,1
>180	0,5	1,1	0,6	-	1,1
Total	171,6	152,5	39,5	58,6	211,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,7 %	1,5 %
15-35	5,1 %	5,0 %
36-60	5,0 %	4,7 %
61-90	5,3 %	4,5 %
91-180	5,6 %	5,4 %
>180	6,6 %	5,6 %
Total	5,7 %	3,1 %

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	51	167	506	476	49	150	508	462	9	53	564	410
Real	157	40	128	159	130	29	86	132	49	5	110	264
Total	207	207	635	635	179	179	594	594	58	58	674	674

* 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 24 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.