

Fecha de publicación: 29 de Noviembre de 2004
 Fecha de Información: 25 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\$187,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	42,5	39,1	2,6	6,0	45,1
15-35	36,4	48,2	21,1	9,2	57,4
36-60	38,0	13,5	0,5	25,0	38,5
61-90	38,0	16,4	5,4	27,0	43,4
91-180	0,7	1,6	0,9	-	1,6
>180	1,0	-	-	1,0	1,0
Total	156,6	118,8	30,4	68,3	187,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	88	164	567	506	9	56	639	464
Real	157	40	129	159	133	57	93	154	52	5	110	285
Total	207	207	635	635	221	221	660	660	61	61	749	749

* 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 26 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.