

Fecha de publicación: 1 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 29 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\$230,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	50,0	57,5	18,5	11,0	68,5
15-35	56,8	63,6	25,0	18,2	81,8
36-60	35,5	42,7	7,7	0,5	43,2
61-90	15,2	15,1	0,1	0,2	15,3
91-180	5,5	10,3	9,8	5,0	15,3
>180	5,0	1,2	1,2	5,0	6,2
Total	168,0	190,5	62,3	39,9	230,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,4 %	-0,1 %
15-35	3,8 %	4,0 %
36-60	3,8 %	4,7 %
61-90	4,1 %	4,5 %
91-180	5,5 %	4,8 %
>180	6,3 %	6,1 %
Total	3,7 %	3,0 %

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	29 de Nov. al 3 de Diciembre				6 al 10 de Diciembre				13 al 17 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	94	165	577	512	10	68	706	539	24	96	492	450
Real	133	63	94	159	64	7	126	293	89	17	181	223
Total	227	227	671	671	74	74	832	832	113	113	673	673

* 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 30 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.