

Fecha de publicación: 4 de Noviembre de 2004
 Fecha de Información: 2 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\$199,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	17,2	39,4	23,4	1,2	40,6
15-35	46,2	35,1	7,6	18,7	53,8
36-60	-	31,5	31,5	-	31,5
61-90	37,1	66,5	29,4	-	66,5
91-180	2,5	2,3	0,0	0,1	2,5
>180	-	5,0	5,0	-	5,0
Total	103,0	179,8	96,9	20,1	199,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,0 %	4,3 %
15-35	3,9 %	4,4 %
36-60	5,4 %	4,9 %
61-90	5,3 %	5,1 %
91-180	5,2 %	5,3 %
>180	5,5 %	5,5 %
Total	4,9 %	4,7 %

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	1 al 5 de Noviembre				8 al 12 de Noviembre				15 al 19 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	49	111	919	747	14	126	568	574	34	103	492	465
Real	80	18	208	380	124	12	177	171	98	28	91	118
Total	129	129	1127	1127	138	138	745	745	131	131	583	583

* 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 3 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.