

Fecha de publicación: 5 de Noviembre de 2004
 Fecha de Información: 3 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\$293,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	71,9	32,9	13,4	52,4	85,3
15-35	97,0	62,4	17,4	52,0	114,4
36-60	0,0	2,2	2,2	-	2,2
61-90	23,1	57,0	46,9	13,0	70,0
91-180	2,0	2,7	0,7	-	2,7
>180	10,0	8,8	8,8	10,0	18,8
Total	204,0	165,9	89,3	127,4	293,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,6 %	3,6 %
15-35	7,8 %	4,6 %
36-60	5,4 %	4,7 %
61-90	4,9 %	4,7 %
91-180	5,7 %	5,4 %
>180	5,8 %	5,7 %
Total	6,2 %	4,4 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.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	128	617	588	35	103	530	498
Real	80	18	208	380	126	12	188	216	98	29	94	126
Total	129	129	1127	1127	140	140	805	805	132	132	624	624

* 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 4 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.