

Fecha de publicación: 10 de Noviembre de 2004
 Fecha de Información: 8 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\$235,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	87,3	63,4	14,9	38,8	102,3
15-35	61,4	78,6	37,6	20,4	99,0
36-60	4,2	18,9	14,9	0,2	19,1
61-90	0,5	4,8	4,3	-	4,8
91-180	9,0	5,3	0,3	4,0	9,3
>180	-	0,5	0,5	-	0,5
Total	162,4	171,6	72,6	63,4	235,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	8 al 12 de Noviembre				15 al 19 de Noviembre				22 al 26 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	66	177	769	680	46	109	623	591	11	133	276	293
Real	175	64	210	299	101	38	104	135	130	8	109	91
Total	241	241	979	979	147	147	726	726	141	141	385	385

* 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 9 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.