

Fecha de publicación: 17 de Noviembre de 2004
 Fecha de Información: 12 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\$211,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	54,5	38,9	12,2	27,8	66,7
15-35	59,1	74,8	21,7	6,1	80,8
36-60	4,1	18,8	14,8	0,1	18,9
61-90	11,5	9,7	9,7	11,5	21,2
91-180	12,0	20,1	8,1	-	20,1
>180	4,0	3,1	0,1	1,0	4,1
Total	145,2	165,3	66,5	46,4	211,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	9,1 %	3,9 %
15-35	5,3 %	5,8 %
36-60	4,9 %	5,4 %
61-90	5,0 %	4,6 %
91-180	5,6 %	5,5 %
>180	6,2 %	6,1 %
Total	6,7 %	5,0 %

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	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	777	686	59	110	724	675	14	145	362	359
Real	175	64	210	301	101	50	128	178	143	12	121	124
Total	241	241	987	987	160	160	852	852	157	157	483	483

* 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 16 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.