

Fecha de publicación: 19 de Noviembre de 2004
 Fecha de Información: 17 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\$330,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24,3	19,8	2,3	6,8	26,6
15-35	200,9	113,4	5,1	92,6	206,1
36-60	0,4	3,4	3,2	0,2	3,6
61-90	59,0	29,1	8,1	38,0	67,1
91-180	7,6	9,7	4,1	2,0	11,7
>180	3,0	12,1	12,1	3,0	15,1
Total	295,3	187,4	34,8	142,6	330,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	15 al 19 de Noviembre				22 al 26 de Noviembre				29 de Nov. al 3 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	59	110	756	704	15	149	400	395	14	139	358	320
Real	101	50	128	179	147	12	124	130	128	4	76	113
Total	160	160	884	884	162	162	524	524	142	142	434	434

* 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 18 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.