

Fecha de publicación: 30 de Noviembre de 2004
 Fecha de Información: 26 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\$294,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	35,5	38,9	12,9	9,5	48,4
15-35	54,5	96,2	81,9	40,2	136,4
36-60	55,1	46,8	16,7	25,0	71,8
61-90	25,1	2,9	1,7	24,0	26,9
91-180	3,6	5,4	1,9	-	5,4
>180	-	5,6	5,6	-	5,6
Total	173,8	195,8	120,7	98,7	294,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	22 al 26 de Noviembre				29 de Nov. al 3 de Dic.				6 al 10 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	51	167	506	476	92	164	577	512	9	67	660	486
Real	157	40	129	159	133	61	94	159	63	6	111	285
Total	207	207	635	635	225	225	671	671	72	72	771	771

* 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 29 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.