

Fecha de publicación: 3 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 1 de Diciembre 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\$166,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14,0	23,3	23,3	14,0	37,3
15-35	47,7	57,8	27,4	17,4	75,1
36-60	12,3	20,6	10,6	2,3	22,9
61-90	23,4	10,4	5,4	18,4	28,8
91-180	1,4	1,2	1,2	1,4	2,6
>180	-	-	-	-	-
Total	98,9	113,3	68,0	53,5	166,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,9 %	12,6 %
15-35	2,6 %	2,8 %
36-60	3,7 %	3,8 %
61-90	3,9 %	3,1 %
91-180	4,6 %	3,9 %
>180	-	-
Total	4,0 %	5,2 %

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	29 de Nov. al 3 de Diciembre				6 al 10 de Diciembre				13 al 17 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	95	165	584	519	12	68	717	567	24	96	514	500
Real	133	64	97	162	64	8	150	300	89	17	222	236
Total	228	228	681	681	76	76	867	867	113	113	736	736

* 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 2 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.