

Fecha de publicación: 6 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 2 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\$420,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	77,1	52,0	6,0	31,1	83,1
15-35	82,7	143,1	82,7	22,3	165,4
36-60	12,4	16,0	12,7	9,1	25,1
61-90	28,6	108,5	101,5	21,6	130,0
91-180	2,3	11,1	11,1	2,3	13,4
>180	3,0	-	-	3,0	3,0
Total	206,1	330,8	213,9	89,3	420,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	27	72	730	576	28	96	570	543
Real	133	64	97	162	64	20	151	305	89	21	227	255
Total	228	228	681	681	92	92	881	881	117	117	797	797

* 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 3 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.