

Fecha de publicación: 9 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 6 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\$272,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,3	42,0	3,0	6,3	48,3
15-35	93,9	49,1	21,1	65,9	115,0
36-60	21,0	42,3	21,3	0,0	42,4
61-90	5,0	5,0	-	-	5,0
91-180	8,2	5,9	0,9	3,2	9,1
>180	53,0	3,0	-	50,0	53,0
Total	226,4	147,4	46,4	125,4	272,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	6 al 10 de Diciembre				13 al 17 de Diciembre				20 al 24 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	28	72	732	583	29	97	632	597	16	86	333	297
Real	64	20	158	307	90	22	235	270	77	7	95	131
Total	92	92	890	890	119	119	867	867	93	93	428	428

* 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 7 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.