

Fecha de publicación: 13 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 9 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\$250,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	59,3	84,9	62,8	37,2	122,1
15-35	54,1	64,9	20,9	10,1	75,0
36-60	12,5	14,4	4,4	2,5	16,9
61-90	18,0	13,6	2,6	7,0	20,6
91-180	12,2	8,9	1,9	5,2	14,1
>180	1,5	0,1	0,1	1,5	1,6
Total	157,7	186,7	92,6	63,6	250,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	67	732	588	39	99	711	731	19	86	370	349
Real	59	20	163	307	92	32	317	297	77	10	126	146
Total	87	87	895	895	131	131	1028	1028	96	96	495	495

* 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 10 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.