

Fecha de publicación: 30 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 28 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\$249,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	25,2	31,4	7,4	1,2	32,6
15-35	88,1	86,6	30,9	32,4	119,1
36-60	35,2	20,4	2,4	17,2	37,5
61-90	17,3	10,0	1,0	8,3	18,3
91-180	7,2	6,0	3,0	4,2	10,2
>180	29,8	12,0	2,0	19,8	31,8
Total	202,8	166,4	46,7	83,1	249,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	27 al 31 de Diciembre				3 al 7 de Enero				10 al 14 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	69	109	532	514	42	94	928	838	41	99	559	550
Real	90	50	188	206	84	32	302	392	97	39	246	255
Total	159	159	720	720	126	126	1230	1230	138	138	805	805

* 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 diciembre se presenta la proyección de vencimientos.