

Fecha de publicación: 03 de Enero de 2005
 Fecha de Información: 29 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\$134,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,5	4,5	4,4	5,4	9,9
15-35	20,6	68,7	56,4	8,3	77,0
36-60	1,0	8,2	8,2	1,0	9,2
61-90	16,8	7,9	7,9	16,8	24,7
91-180	1,1	2,0	2,0	1,1	3,1
>180	1,4	9,2	9,0	1,2	10,4
Total	46,4	100,3	87,8	33,8	134,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,5 %	5,2 %
15-35	7,2 %	15,8 %
36-60	0,1 %	0,8 %
61-90	3,0 %	3,8 %
91-180	4,1 %	4,1 %
>180	5,2 %	5,5 %
Total	4,2 %	10,7 %

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	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	108	532	514	44	94	928	843	41	101	569	569
Real	89	50	188	206	84	33	307	393	99	39	260	261
Total	158	158	720	720	127	127	1236	1236	140	140	830	830

* 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 30 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.