

Fecha de publicación: 4 de Enero de 2005
 Fecha de Información: 30 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\$118,4 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	6,9	0,1	0,1	6,9	7,0
15-35	7,7	61,8	60,8	6,7	68,4
36-60	7,6	7,2	0,2	0,6	7,8
61-90	-	0,3	0,3	-	0,3
91-180	1,8	2,8	2,8	1,8	4,6
>180	30,0	0,3	0,3	30,0	30,3
Total	53,9	72,5	64,5	45,9	118,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,4 %	-5,3 %
15-35	3,2 %	2,1 %
36-60	3,3 %	4,1 %
61-90	2,1 %	2,1 %
91-180	2,7 %	2,2 %
>180	5,4 %	4,8 %
Total	4,4 %	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	108	532	514	44	94	929	844	45	101	572	599
Real	89	50	188	206	84	34	308	393	99	43	290	264
Total	158	158	720	720	128	128	1237	1237	144	144	862	862

* 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 31 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.