

Fecha de publicación: 14 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 10 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\$339,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	66,9	36,8	9,8	39,9	76,7
15-35	73,0	41,5	20,0	51,5	93,0
36-60	22,1	47,8	44,7	19,0	66,8
61-90	44,0	36,7	12,7	20,0	56,7
91-180	17,5	23,7	8,7	2,5	26,2
>180	10,4	9,2	9,2	10,4	19,6
Total	234,0	195,6	105,0	143,3	339,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

Vencimientos de Forwards

Sector	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	42	105	734	747	19	87	410	364
Real	59	20	163	307	97	35	318	306	78	11	128	173
Total	87	87	895	895	139	139	1052	1052	98	98	538	538

* 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 13 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.