

Fecha de publicación: 15 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 13 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\$340,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	114,7	79,9	5,3	40,1	120,0
15-35	82,1	53,5	20,4	49,0	102,4
36-60	9,4	39,8	37,8	7,4	47,3
61-90	20,3	11,0	11,0	20,3	31,3
91-180	7,6	28,6	23,6	2,6	31,3
>180	1,1	6,6	6,6	1,1	7,7
Total	235,2	219,5	104,8	120,5	340,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,4 %	11,5 %
15-35	5,2 %	3,9 %
36-60	4,9 %	5,9 %
61-90	2,2 %	1,0 %
91-180	4,3 %	4,8 %
>180	4,8 %	4,5 %
Total	4,9 %	6,7 %

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	13 al 17 de Diciembre				20 al 24 de Diciembre				27 al 31 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	46	105	768	781	20	87	459	397	13	79	264	311
Real	97	38	320	308	78	11	128	189	72	6	150	102
Total	143	143	1088	1088	98	98	586	586	85	85	414	414

* 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 14 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.