

Fecha de publicación: 16 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 14 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\$368,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	133,0	109,1	25,1	49,0	158,1
15-35	126,0	114,5	19,5	31,0	145,5
36-60	0,9	1,9	1,9	0,9	2,9
61-90	18,1	17,7	8,7	9,1	26,8
91-180	1,6	1,2	1,2	1,6	2,8
>180	15,0	20,5	17,5	12,0	32,5
Total	294,6	265,0	74,0	103,6	368,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,5 %	10,5 %
15-35	3,9 %	6,4 %
36-60	4,7 %	5,2 %
61-90	5,4 %	6,2 %
91-180	5,2 %	4,1 %
>180	5,4 %	4,8 %
Total	4,6 %	8,0 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.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	769	781	21	87	532	441	13	79	338	391
Real	97	38	320	308	79	12	145	236	72	6	158	106
Total	143	143	1089	1089	100	100	677	677	85	85	497	497

* 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 15 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.