

Fecha de publicación: 17 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 15 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\$403,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	59,6	51,9	14,9	22,6	74,6
15-35	79,7	130,8	66,3	15,2	146,0
36-60	1,8	9,4	9,4	1,8	11,2
61-90	28,4	77,6	67,5	18,2	95,9
91-180	16,3	10,9	10,5	15,9	26,8
>180	35,0	26,0	14,0	23,0	49,0
Total	220,8	306,7	182,6	96,8	403,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	22	88	565	456	13	79	365	427
Real	97	38	320	308	79	13	148	256	72	6	169	107
Total	143	143	1089	1089	101	101	713	713	85	85	534	534

* 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 16 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.