

Fecha de publicación: 23 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 21 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\$479,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	65,4	8,1	3,0	60,3	68,4
15-35	115,3	88,1	61,0	88,2	176,3
36-60	13,5	25,3	25,2	13,4	38,6
61-90	48,7	16,6	1,5	33,6	50,2
91-180	58,8	31,6	5,4	32,6	64,2
>180	35,2	46,6	46,5	35,1	81,7
Total	336,9	216,2	142,5	263,3	479,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	20 al 24 de Diciembre				27 al 31 de Diciembre				3 al 7 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	36	88	624	512	49	79	471	471	18	93	831	714
Real	79	28	163	275	73	42	172	171	82	8	253	369
Total	116	116	787	787	121	121	642	642	100	100	1083	1083

* 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 22 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.