

Fecha de publicación: 24 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 22 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\$315,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	76,9	53,4	22,0	45,5	98,9
15-35	60,3	145,1	114,7	29,9	175,0
36-60	15,5	5,5	5,5	15,5	20,9
61-90	5,6	4,9	4,9	5,6	10,5
91-180	1,9	4,2	4,1	1,8	6,0
>180	0,5	3,6	3,2	0,1	3,7
Total	160,7	216,6	154,3	98,3	315,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	28,0 %	7,3 %
15-35	1,7 %	6,7 %
36-60	3,1 %	-3,2 %
61-90	1,0 %	-6,1 %
91-180	3,2 %	4,8 %
>180	4,6 %	4,5 %
Total	9,1 %	5,8 %

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	61	87	523	501	21	93	846	764
Real	79	28	163	275	73	46	183	204	83	11	298	381
Total	116	116	787	787	134	134	706	706	104	104	1144	1144

* 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 23 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.