

Fecha de publicación: 27 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 23 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\$157,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	25,0	19,8	2,5	7,7	27,5
15-35	86,8	50,1	2,8	39,5	89,6
36-60	12,0	13,2	3,2	2,0	15,2
61-90	5,9	2,7	2,7	5,9	8,5
91-180	5,0	4,6	4,6	5,0	9,6
>180	6,9	0,3	0,3	6,9	7,2
Total	141,5	90,5	16,0	67,0	157,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	65	87	531	510	22	94	865	780
Real	79	28	163	275	73	50	185	205	84	12	298	383
Total	116	116	787	787	137	137	716	716	106	106	1163	1163

* 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 24 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.