

Fecha de publicación: 28 de Diciembre de 2004  
 Fecha de Información: 24 de Diciembre de 2004 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$86,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 14,0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	19,8	22,3	20,3	17,8	40,1
15-35	30,0	20,3	12,3	22,0	42,3
36-60	-	-	-	-	-
61-90	-	0,9	0,9	-	0,9
91-180	-	1,2	1,2	-	1,2
>180	-	1,6	1,6	-	1,6
<b>Total</b>	<b>49,8</b>	<b>46,2</b>	<b>36,2</b>	<b>39,8</b>	<b>86,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

**Cuadro No. 2**  
**Devaluación Implícita Anualizada**

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	19,5 %	16,5 %
15-35	8,8 %	12,5 %
36-60	-	-
61-90	5,3 %	4,5 %
91-180	4,2 %	4,4 %
>180	4,6 %	4,6 %
<b>Total</b>	<b>9,5 %</b>	<b>14,0 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

**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
<b>Financiero</b>	36	88	624	512	65	104	532	514	39	94	867	782
<b>Real</b>	79	28	163	275	89	50	188	206	84	28	298	383
<b>Total</b>	116	116	787	787	154	154	720	720	122	122	1165	1165

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

<sup>3</sup> A partir del 27 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.