

Fecha de publicación: 29 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 27 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\$238,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -2,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,4	33,3	0,3	11,4	44,7
15-35	104,7	66,6	37,0	75,1	141,7
36-60	24,7	27,5	3,5	0,7	28,2
61-90	0,8	0,3	0,3	0,8	1,1
91-180	9,3	14,2	9,9	5,0	19,2
>180	3,8	-	-	3,8	3,8
Total	187,7	141,9	51,0	96,9	238,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Vencimientos de Forwards

Sectores	27 al 31 de Diciembre				3 al 7 de Enero				10 al 14 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	69	109	532	514	41	94	904	810	40	95	538	536
Real	90	50	188	206	84	31	298	392	94	38	236	238
Total	159	159	720	720	125	125	1202	1202	134	134	774	774

* 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 28 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.