

Fecha de publicación: 7 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 3 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\$83,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 27,1 | 10,5 | 0,5 | 17,0 | 27,6 |
| 15-35 | 26,5 | 30,1 | 6,1 | 2,5 | 32,6 |
| 36-60 | 0,0 | 7,9 | 7,9 | 0,0 | 7,9 |
| 61-90 | 5,0 | 0,8 | 0,8 | 5,0 | 5,8 |
| 91-180 | 3,7 | 2,7 | 2,7 | 3,7 | 6,4 |
| >180 | - | 3,3 | 3,3 | - | 3,3 |
| Total | 62,4 | 55,2 | 21,2 | 28,3 | 83,6 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 16,1 % | 4,7 % |
| 15-35 | 3,4 % | 3,4 % |
| 36-60 | 3,0 % | 3,0 % |
| 61-90 | 4,1 % | 3,8 % |
| 91-180 | 4,5 % | 3,9 % |
| >180 | 6,2 % | 5,7 % |
| Total | 6,5 % | 3,9 % |

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 | 29 de Nov. al 3 de Diciembre | | | | 6 al 10 de Diciembre | | | | 13 al 17 de Diciembre | | | |
|-------------------|------------------------------|-----|-----|-----|----------------------|----|-----|-----|-----------------------|-----|-----|-----|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Financiero | 95 | 165 | 584 | 519 | 27 | 72 | 732 | 576 | 28 | 97 | 595 | 553 |
| Real | 133 | 64 | 97 | 162 | 64 | 20 | 152 | 307 | 89 | 21 | 227 | 270 |
| Total | 228 | 228 | 681 | 681 | 92 | 92 | 883 | 883 | 117 | 117 | 822 | 822 |

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

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

³ A partir del 6 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.