

Fecha de publicación: 16 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 14 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\$368,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|-------------|--------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 133,0 | 109,1 | 25,1 | 49,0 | 158,1 |
| 15-35 | 126,0 | 114,5 | 19,5 | 31,0 | 145,5 |
| 36-60 | 0,9 | 1,9 | 1,9 | 0,9 | 2,9 |
| 61-90 | 18,1 | 17,7 | 8,7 | 9,1 | 26,8 |
| 91-180 | 1,6 | 1,2 | 1,2 | 1,6 | 2,8 |
| >180 | 15,0 | 20,5 | 17,5 | 12,0 | 32,5 |
| Total | 294,6 | 265,0 | 74,0 | 103,6 | 368,6 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 4,5 % | 10,5 % |
| 15-35 | 3,9 % | 6,4 % |
| 36-60 | 4,7 % | 5,2 % |
| 61-90 | 5,4 % | 6,2 % |
| 91-180 | 5,2 % | 4,1 % |
| >180 | 5,4 % | 4,8 % |
| Total | 4,6 % | 8,0 % |

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

Vencimientos de Forwards

| Sectores | 13 al 17 de Diciembre | | | | 20 al 24 de Diciembre | | | | 27 al 31 de Diciembre | | | |
|-------------------|-----------------------|-----|------|------|-----------------------|-----|-----|-----|-----------------------|----|-----|-----|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Financiero | 46 | 105 | 769 | 781 | 21 | 87 | 532 | 441 | 13 | 79 | 338 | 391 |
| Real | 97 | 38 | 320 | 308 | 79 | 12 | 145 | 236 | 72 | 6 | 158 | 106 |
| Total | 143 | 143 | 1089 | 1089 | 100 | 100 | 677 | 677 | 85 | 85 | 497 | 497 |

* 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 15 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.