

Fecha de publicación: 17 de Diciembre de 2004
 Fecha de Información: 15 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\$403,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 59,6 | 51,9 | 14,9 | 22,6 | 74,6 |
| 15-35 | 79,7 | 130,8 | 66,3 | 15,2 | 146,0 |
| 36-60 | 1,8 | 9,4 | 9,4 | 1,8 | 11,2 |
| 61-90 | 28,4 | 77,6 | 67,5 | 18,2 | 95,9 |
| 91-180 | 16,3 | 10,9 | 10,5 | 15,9 | 26,8 |
| >180 | 35,0 | 26,0 | 14,0 | 23,0 | 49,0 |
| Total | 220,8 | 306,7 | 182,6 | 96,8 | 403,4 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 | 22 | 88 | 565 | 456 | 13 | 79 | 365 | 427 |
| Real | 97 | 38 | 320 | 308 | 79 | 13 | 148 | 256 | 72 | 6 | 169 | 107 |
| Total | 143 | 143 | 1089 | 1089 | 101 | 101 | 713 | 713 | 85 | 85 | 534 | 534 |

* 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 16 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.