

Fecha de publicación: 21 de Diciembre de 2004  
 Fecha de Información: 17 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\$265,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	54,1	19,6	0,6	35,1	54,6
15-35	112,2	85,4	24,0	50,8	136,2
36-60	3,6	12,8	11,5	2,3	15,1
61-90	29,5	29,4	4,5	4,6	33,9
91-180	5,8	13,4	8,2	0,6	14,0
>180	2,2	9,6	9,4	2,0	11,6
<b>Total</b>	<b>207,4</b>	<b>170,2</b>	<b>58,1</b>	<b>95,3</b>	<b>265,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

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

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

**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
<b>Financiero</b>	46	105	769	781	35	88	612	489	14	79	408	455
<b>Real</b>	97	38	320	308	79	27	150	273	72	7	170	123
<b>Total</b>	143	143	1089	1089	115	115	762	762	86	86	578	578

\* 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 20 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.