

Fecha de publicación: 4 de Enero de 2005  
 Fecha de Información: 30 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\$118,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6,9	0,1	0,1	6,9	7,0
15-35	7,7	61,8	60,8	6,7	68,4
36-60	7,6	7,2	0,2	0,6	7,8
61-90	-	0,3	0,3	-	0,3
91-180	1,8	2,8	2,8	1,8	4,6
>180	30,0	0,3	0,3	30,0	30,3
<b>Total</b>	<b>53,9</b>	<b>72,5</b>	<b>64,5</b>	<b>45,9</b>	<b>118,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

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

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

**Cuadro No. 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
<b>Financiero</b>	69	108	532	514	44	94	929	844	45	101	572	599
<b>Real</b>	89	50	188	206	84	34	308	393	99	43	290	264
<b>Total</b>	158	158	720	720	128	128	1237	1237	144	144	862	862

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 31 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.