

Fecha de publicación: 5 de Enero de 2005
 Fecha de Información: 3 de Enero de 2005 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\$238,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	21,3	15,0	15,0	21,3	36,3
15-35	84,3	118,1	52,1	18,3	136,5
36-60	36,1	15,2	0,2	21,1	36,3
61-90	5,0	5,9	0,9	-	5,9
91-180	1,8	10,0	10,0	1,8	11,8
>180	6,0	5,7	5,7	6,0	11,7
Total	154,5	170,1	84,1	68,5	238,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	3 al 7 de Enero				10 al 14 de Enero				17 al 21 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	44	94	929	845	45	102	587	612	14	106	566	564
Real	84	34	309	393	100	43	303	279	105	13	304	305
Total	128	128	1238	1238	145	145	891	891	119	119	869	869

* 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 4 de enero se presenta la proyección de vencimientos.