

Fecha de publicación: 07 de Enero de 2005  
 Fecha de Información 05 de Enero de 2005 <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\$456,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de  $-0,8\%$ .<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	97,2	49,3	0,3	48,1	97,5
15-35	170,8	193,5	69,0	46,3	239,8
36-60	12,2	54,2	42,2	0,2	54,4
61-90	35,1	17,6	5,5	23,0	40,6
91-180	10,7	2,1	1,5	10,1	12,2
>180	9,5	7,0	2,0	4,5	11,5
<b>Total</b>	<b>335,5</b>	<b>323,8</b>	<b>120,5</b>	<b>132,3</b>	<b>456,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-8,8 %	-7,2 %
15-35	-0,4 %	0,0 %
36-60	3,3 %	2,5 %
61-90	4,3 %	2,8 %
91-180	4,0 %	2,1 %
>180	3,7 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>-0,9 %</b>	<b>-0,8 %</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	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	979	876	51	102	833	720	14	106	633	648
Real	84	34	309	412	100	50	304	417	105	13	346	332
<b>Total</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>1288</b>	<b>1288</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>1137</b>	<b>1137</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>979</b>	<b>979</b>

\* 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 6 de enero se presenta la proyección de vencimientos.