

Fecha de publicación: 08 de Enero de 2005  
 Fecha de Información: 06 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\$252,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	64,7	43,7	0,5	21,5	65,2
15-35	57,0	73,2	33,2	17,0	90,2
36-60	68,4	71,5	3,5	0,4	71,9
61-90	11,7	8,1	0,6	4,2	12,3
91-180	0,4	0,3	0,3	0,4	0,7
>180	11,7	0,5	0,5	11,7	12,2
<b>Total</b>	<b>214,0</b>	<b>197,3</b>	<b>38,6</b>	<b>55,3</b>	<b>252,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,2 %	4,9 %
15-35	5,9 %	7,4 %
36-60	2,6 %	2,6 %
61-90	2,1 %	2,1 %
91-180	2,6 %	2,6 %
>180	3,8 %	4,4 %
<b>Total</b>	<b>3,0 %</b>	<b>5,0 %</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
<b>Financiero</b>	44	94	979	876	52	102	855	735	15	106	689	690
<b>Real</b>	84	34	309	412	100	50	304	424	105	14	346	345
<b>Total</b>	128	128	1288	1288	152	152	1159	1159	120	120	1035	1035

\* 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 7 de enero se presenta la proyección de vencimientos.