

Fecha de publicación: 09 de Enero de 2005
 Fecha de Información 07 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\$233,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -2,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	43,0	30,9	6,4	18,5	49,4
15-35	86,2	72,1	36,1	50,2	122,3
36-60	27,3	32,6	5,6	0,3	32,9
61-90	15,5	15,2	2,7	3,0	18,2
91-180	0,5	0,2	0,1	0,5	0,6
>180	10,2	0,5	0,3	10,0	10,5
Total	182,7	151,5	51,2	82,4	233,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	18,6 %	4,0 %
15-35	-3,6 %	-6,7 %
36-60	3,8 %	2,2 %
61-90	1,7 %	0,1 %
91-180	4,3 %	4,0 %
>180	4,7 %	3,6 %
Total	6,6 %	-2,1 %

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	979	876	60	102	875	751	15	106	708	705
Real	84	34	309	412	100	58	305	429	105	14	352	355
Total	128	128	1288	1288	160	160	1180	1180	120	120	1060	1060

* 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 10 de enero se presenta la proyección de vencimientos.