

Fecha de publicación: 13 de Enero de 2005
 Fecha de Información: 11 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\$241,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,7\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	37,8	18,1	5,5	25,2	43,3
15-35	57,9	77,1	38,1	18,9	96,0
36-60	18,3	30,2	12,2	0,3	30,5
61-90	8,6	1,5	1,5	8,6	10,1
91-180	9,1	35,0	35,0	9,1	44,1
>180	17,0	17,0	-	-	17,0
Total	148,7	178,9	92,3	62,1	241,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-11,0 %	-10,8 %
15-35	0,5 %	0,5 %
36-60	1,0 %	1,4 %
61-90	1,0 %	1,0 %
91-180	2,4 %	3,3 %
>180	3,0 %	3,1 %
Total	-2,8 %	-0,7 %

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	10 al 14 de Enero				17 al 21 de Enero				24 al 28 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	61	102	890	751	16	106	726	721	15	79	516	478
Real	100	59	305	445	105	15	357	363	77	13	224	262
Total	161	161	1196	1196	120	120	1083	1083	92	92	740	740

* 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 12 de enero se presenta la proyección de vencimientos.