

Fecha de publicación: 14 de Enero de 2005
 Fecha de Información: 12 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\$319,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	69,4	65,8	7,8	11,4	77,3
15-35	75,7	72,4	46,9	50,2	122,5
36-60	38,0	28,2	4,2	14,0	42,2
61-90	36,7	33,6	27,1	30,2	63,8
91-180	3,0	12,0	9,0	-	12,0
>180	-	1,5	1,5	-	1,5
Total	222,9	213,4	96,4	105,9	319,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,1 %	6,4 %
15-35	3,4 %	2,5 %
36-60	0,6 %	1,1 %
61-90	2,3 %	1,0 %
91-180	3,6 %	4,8 %
>180	3,6 %	3,8 %
Total	3,7 %	3,0 %

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	17	106	768	757	15	79	555	512
Real	100	59	305	445	105	16	362	373	77	13	227	270
Total	161	161	1196	1196	122	122	1130	1130	92	92	783	783

* 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 13 de enero se presenta la proyección de vencimientos.