

Fecha de publicación: 18 de Enero de 2005  
 Fecha de Información: 14 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\$278,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	52,2	55,3	20,8	17,7	73,0
15-35	81,5	116,7	76,7	41,5	158,2
36-60	24,6	10,0	4,0	18,6	28,5
61-90	1,2	6,7	6,5	1,0	7,7
91-180	7,9	7,6	0,6	0,9	8,4
>180	2,1	0,5	0,5	2,1	2,6
<b>Total</b>	<b>169,5</b>	<b>196,7</b>	<b>109,0</b>	<b>81,8</b>	<b>278,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,4 %	-2,5 %
15-35	0,9 %	1,0 %
36-60	1,0 %	0,6 %
61-90	2,6 %	1,9 %
91-180	3,9 %	3,4 %
>180	4,3 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>0,7 %</b>	<b>0,2 %</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	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
<b>Financiero</b>	61	102	890	751	24	106	846	814	18	79	631	589
<b>Real</b>	100	59	305	445	105	23	372	404	77	16	247	289
<b>Total</b>	161	161	1196	1196	129	129	1218	1218	95	95	878	878

\* 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 17 de enero se presenta la proyección de vencimientos.