

Fecha de publicación: 19 de Enero de 2005
 Fecha de Información: 17 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\$160,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	39,8	32,0	28,7	36,5	68,4
15-35	35,3	31,0	11,0	15,3	46,4
36-60	15,7	40,2	25,2	0,7	41,0
61-90	0,6	1,5	1,3	0,4	1,9
91-180	0,8	0,3	0,3	0,8	1,1
>180	2,0	-	-	2,0	2,0
Total	94,2	105,0	66,5	55,7	160,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-8,1 %	19,1 %
15-35	-0,8 %	2,2 %
36-60	0,7 %	2,1 %
61-90	2,0 %	1,7 %
91-180	2,5 %	2,7 %
>180	4,5 %	4,6 %
Total	-3,7 %	9,4 %

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	17 al 21 de Enero				24 al 28 de Enero				31 de Ene. al 4 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	27	106	852	825	22	79	657	606	28	170	511	578
Real	105	26	382	409	77	20	262	314	152	10	281	214
Total	132	132	1233	1233	99	99	919	919	181	181	792	792

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 18 de enero se presenta la proyección de vencimientos.