

Fecha de publicación: 21 de Enero de 2005  
 Fecha de Información: 19 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\$242,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	73,7	64,6	25,5	34,7	99,3
15-35	74,0	54,2	19,2	39,0	93,2
36-60	14,3	17,7	7,7	4,3	22,0
61-90	2,0	4,8	2,8	-	4,8
91-180	17,6	17,0	5,9	6,5	23,4
>180	-	0,0	0,0	-	0,0
<b>Total</b>	<b>181,6</b>	<b>158,3</b>	<b>61,2</b>	<b>84,5</b>	<b>242,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,2 %	4,5 %
15-35	0,7 %	2,2 %
36-60	1,4 %	0,6 %
61-90	3,2 %	3,4 %
91-180	3,9 %	3,8 %
>180	5,7 %	5,7 %
<b>Total</b>	<b>1,4 %</b>	<b>3,2 %</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	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
<b>Financiero</b>	28	106	860	831	26	79	781	717	30	170	582	686
<b>Real</b>	105	27	383	412	78	24	295	359	152	12	336	232
<b>Total</b>	134	134	1243	1243	103	103	1076	1076	183	183	918	918

\* 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 20 de enero se presenta la proyección de vencimientos.