

Fecha de publicación: 25 de Enero de 2005
 Fecha de Información: 21 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\$279,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,4\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	97,8	76,2	23,1	44,7	120,9
15-35	74,5	68,6	28,6	34,5	103,1
36-60	16,4	18,3	2,3	0,4	18,8
61-90	15,5	24,0	14,0	5,5	29,5
91-180	3,8	5,3	3,3	1,8	7,1
>180	-	-	-	-	-
Total	208,1	192,4	71,3	87,0	279,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	28	106	860	821	29	79	860	784	37	170	673	762
Real	105	27	373	412	78	27	299	376	152	19	367	279
Total	134	134	1233	1233	106	106	1160	1160	189	189	1040	1040

* 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 24 de enero se presenta la proyección de vencimientos.