

Fecha de publicación: 26 de Enero de 2005
 Fecha de Información: 24 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\$233,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	61,3	33,1	13,0	41,2	74,3
15-35	53,0	95,5	65,1	22,6	118,1
36-60	21,5	20,5	2,0	3,0	23,4
61-90	3,0	6,6	5,1	1,5	8,1
91-180	1,7	5,9	5,9	1,7	7,6
>180	-	2,4	2,4	-	2,4
Total	140,3	163,9	93,4	69,9	233,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

Vencimientos de Forwards

Sectores	24 al 28 de Enero				31 de Ene. al 4 de Febrero				7 al 11 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	30	80	861	784	39	170	723	788	9	145	591	399
Real	78	28	299	377	152	21	380	316	144	8	115	307
Total	108	108	1161	1161	191	191	1103	1103	153	153	706	706

* 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 25 de enero se presenta la proyección de vencimientos.