

Fecha de publicación: 27 de Enero de 2005
 Fecha de Información: 25 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\$350,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,7\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	55,2	85,0	46,3	16,5	101,5
15-35	125,4	115,2	46,7	56,9	172,1
36-60	7,4	6,8	1,8	2,4	9,1
61-90	-	30,6	30,6	-	30,6
91-180	3,4	1,6	1,6	3,4	5,0
>180	13,0	32,0	19,0	-	32,0
Total	204,3	271,1	146,0	79,1	350,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	32	80	862	816	40	179	759	818	11	145	653	434
Real	78	30	332	378	161	22	385	327	144	10	120	339
Total	110	110	1194	1194	201	201	1144	1144	155	155	774	774

* 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 26 de enero se presenta la proyección de vencimientos.