

Fecha de publicación: 28 de Enero de 2005  
 Fecha de Información: 26 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\$154,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	21,4	20,5	4,5	5,4	25,9
15-35	19,4	94,6	78,6	3,4	98,0
36-60	2,0	0,1	0,1	2,0	2,1
61-90	16,2	17,9	1,9	0,2	18,0
91-180	1,0	2,5	2,5	1,0	3,5
>180	7,0	7,5	0,5	-	7,5
<b>Total</b>	<b>67,0</b>	<b>143,0</b>	<b>88,0</b>	<b>11,9</b>	<b>154,9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,7 %	-0,2 %
15-35	1,0 %	0,9 %
36-60	3,2 %	-0,3 %
61-90	6,4 %	2,8 %
91-180	2,8 %	2,7 %
>180	4,1 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>1,0 %</b>	<b>1,1 %</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	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
<b>Financiero</b>	32	80	862	816	40	179	777	837	12	151	662	441
<b>Real</b>	78	30	332	378	161	22	390	330	150	11	120	341
<b>Total</b>	110	110	1194	1194	202	202	1167	1167	162	162	782	782

\* 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 27 de enero se presenta la proyección de vencimientos.