

Fecha de publicación: 31 de Enero de 2005  
 Fecha de Información: 27 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\$285,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	86,7	77,5	63,2	72,5	150,0
15-35	34,5	67,6	48,1	15,0	82,6
36-60	0,1	6,5	6,5	0,1	6,6
61-90	17,2	16,6	0,6	1,2	17,7
91-180	26,6	27,4	2,4	1,6	28,9
>180	-	0,1	0,1	-	0,1
<b>Total</b>	<b>165,1</b>	<b>195,6</b>	<b>120,8</b>	<b>90,3</b>	<b>285,9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,1 %	4,8 %
15-35	2,3 %	2,5 %
36-60	1,6 %	1,6 %
61-90	3,1 %	2,8 %
91-180	3,9 %	4,0 %
>180	12,2 %	13,2 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,9 %</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
Financiero	32	80	862	816	93	180	804	882	13	193	668	457
Real	78	30	332	378	161	75	423	346	192	12	133	344
<b>Total</b>	<b>110</b>	<b>110</b>	<b>1194</b>	<b>1194</b>	<b>254</b>	<b>254</b>	<b>1227</b>	<b>1227</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>801</b>	<b>801</b>

\* 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 28 de enero se presenta la proyección de vencimientos.