

Fecha de publicación: 1 de Febrero de 2005
 Fecha de Información: 28 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\$249,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	41,2	54,5	34,3	21,0	75,6
15-35	84,0	57,6	22,4	48,8	106,4
36-60	5,4	22,1	18,0	1,3	23,4
61-90	0,4	20,8	20,8	0,4	21,2
91-180	-	11,1	11,1	-	11,1
>180	2,0	10,0	10,0	2,0	12,0
Total	133,1	176,2	116,6	73,6	249,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	94	180	819	925	15	193	691	467
Real	78	30	332	378	161	76	458	352	192	14	133	357
Total	110	110	1194	1194	256	256	1277	1277	207	207	824	824

* 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 31 de enero se presenta la proyección de vencimientos.