

Fecha de publicación: 08 de Marzo de 2005
 Fecha de Información: 04 de Marzo 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\$253,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	69,6	68,4	12,2	13,4	81,8
15-35	51,1	87,9	63,9	27,0	114,9
36-60	10,2	19,3	19,3	10,2	29,5
61-90	1,3	0,5	0,5	1,3	1,9
91-180	7,2	21,1	16,0	2,1	23,2
>180	2,0	2,0	-	-	2,0
Total	141,4	199,2	111,8	54,1	253,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	28 de Feb. al 4 de Marzo				7 al 11 de Marzo				14 al 18 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	32	107	815	652	19	177	824	838	43	166	662	579
Real	96	22	231	394	177	19	340	326	155	32	250	333
Total	129	129	1046	1046	196	196	1164	1164	198	198	912	912

* 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 7 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.