

Fecha de publicación: 2 de Febrero de 2005
 Fecha de Información: 31 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\$256,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	53,1	49,4	13,1	16,9	66,2
15-35	57,2	84,0	54,5	27,7	111,7
36-60	9,8	17,1	9,1	1,8	18,9
61-90	2,4	0,6	0,6	2,4	2,9
91-180	5,0	10,0	5,0	-	10,0
>180	45,0	7,0	2,0	40,0	47,0
Total	172,4	168,1	84,3	88,7	256,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	31 de Ene. al 4 de Febrero				7 al 11 de Febrero				14 al 18 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	94	183	827	937	16	193	717	494	26	53	492	457
Real	164	76	466	357	192	15	134	357	53	26	215	250
Total	259	259	1294	1294	208	208	851	851	79	79	707	707

* 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 1 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.