

Fecha de publicación: 08 de Febrero de 2005
 Fecha de Información: 04 de Febrero 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\$218,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	37,5	34,0	8,5	11,9	45,9
15-35	53,6	72,0	51,0	32,6	104,6
36-60	7,7	21,3	15,1	1,5	22,8
61-90	24,8	21,4	7,4	10,8	32,1
91-180	-	12,4	12,4	-	12,4
>180	-	0,6	0,6	-	0,6
Total	123,6	161,7	94,9	56,8	218,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	99	188	840	951	29	204	824	584	35	58	590	525
Real	170	80	468	357	203	27	148	387	58	35	219	284
Total	269	269	1308	1308	232	232	972	972	93	93	809	809

* 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 febrero se presenta la proyección de vencimientos.