

Fecha de publicación: 09 de Febrero de 2005
 Fecha de Información: 07 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\$222,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,1	24,7	0,0	20,4	45,1
15-35	97,8	78,2	32,2	51,8	129,9
36-60	4,0	13,5	13,5	4,0	17,5
61-90	0,5	-	-	0,5	0,5
91-180	13,4	10,4	0,4	3,4	13,8
>180	15,4	2,1	0,1	13,4	15,5
Total	176,3	128,8	46,1	93,6	222,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	7 al 11 de Febrero				14 al 18 de Febrero				21 al 25 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	30	204	844	589	37	58	612	545	15	186	570	483
Real	203	28	148	404	58	36	219	286	185	13	221	307
Total	233	233	993	993	94	94	831	831	199	199	791	791

* 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 8 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.