

Fecha de publicación: 15 de Enero de 2005
 Fecha de Información 11 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\$231,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	47,7	27,0	3,0	23,7	50,7
15-35	27,6	89,7	67,7	5,6	95,3
36-60	39,8	12,8	5,8	32,8	45,7
61-90	15,4	22,9	7,7	0,3	23,1
91-180	9,3	10,8	2,4	1,0	11,8
>180	1,3	3,8	3,5	1,0	4,8
Total	141,3	167,0	90,1	64,4	231,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	850	594	39	61	709	647	19	188	691	574
Real	203	29	149	404	61	38	254	316	187	17	222	340
Total	233	233	999	999	99	99	963	963	206	206	913	913

* 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 14 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.