

Fecha de publicación: 16 de Enero de 2005
Fecha de Información: 14 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\$426,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	80,5	65,3	8,8	24,0	89,3
15-35	68,7	87,7	55,2	36,2	123,8
36-60	49,4	34,1	19,1	34,4	68,4
61-90	47,0	42,6	5,6	10,0	52,6
91-180	46,0	78,3	41,4	9,1	87,4
>180	3,6	3,4	1,4	1,6	5,0
Total	295,1	311,4	131,5	115,2	426,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	14 al 18 de Febrero				21 al 25 de Febrero				28 de Feb. al 4 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	39	61	721	649	19	188	746	634	21	84	470	378
Real	61	38	256	328	187	18	227	340	73	11	167	259
Total	99	99	977	977	206	206	974	974	95	95	637	637

* 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 15 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.