

Fecha de publicación: 18 de Enero de 2005
 Fecha de Información: 16 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\$238,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	55,8	47,6	1,7	9,9	57,5
15-35	74,6	82,4	47,7	39,9	122,4
36-60	16,5	5,3	3,3	14,5	19,8
61-90	2,8	6,5	6,4	2,7	9,2
91-180	20,1	4,9	4,7	19,9	24,8
>180	3,1	1,5	1,5	3,1	4,6
Total	172,8	148,1	65,3	90,0	238,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	752	679	23	189	837	706	22	89	541	440
Real	61	39	257	330	188	21	235	365	79	12	193	295
Total	100	100	1009	1009	211	211	1072	1072	101	101	734	734

* 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 17 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.