

Fecha de publicación: 22 de Enero de 2005
 Fecha de Información: 18 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\$351,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	56,7	66,2	21,8	12,3	78,5
15-35	94,6	112,6	41,6	23,6	136,2
36-60	17,6	18,1	17,7	17,1	35,3
61-90	10,7	8,3	7,5	9,8	18,2
91-180	39,0	52,4	31,3	17,9	70,2
>180	8,7	4,6	4,4	8,5	13,1
Total	227,2	262,3	124,3	89,2	351,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	25	190	910	783	25	93	614	487
Real	61	39	257	330	189	24	246	374	83	14	202	328
Total	100	100	1009	1009	214	214	1157	1157	108	108	816	816

* 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 21 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.