

Fecha de publicación: 24 de Febrero de 2005
 Fecha de Información: 22 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\$506,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 51,1 | 43,8 | 20,7 | 28,0 | 71,8 |
| 15-35 | 126,5 | 68,2 | 43,7 | 102,0 | 170,2 |
| 36-60 | 43,2 | 45,6 | 45,2 | 42,8 | 88,4 |
| 61-90 | 51,7 | 42,6 | 6,5 | 15,7 | 58,2 |
| 91-180 | 31,6 | 7,2 | 7,1 | 31,4 | 38,6 |
| >180 | 59,2 | 22,7 | 20,3 | 56,8 | 79,5 |
| Total | 363,2 | 230,2 | 143,6 | 276,6 | 506,8 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 | 21 al 25 de Febrero | | | | 28 de Feb. al 4 de Marzo | | | | 7 al 11 de Marzo | | | |
|-------------------|---------------------|-----|-------|------|--------------------------|-----|-----|-----|------------------|-----|-----|-----|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Financiero | 26 | 190 | 925 | 795 | 26 | 107 | 693 | 544 | 10 | 160 | 621 | 494 |
| Real | 189 | 25 | 248 | 378 | 96 | 16 | 203 | 352 | 160 | 10 | 154 | 281 |
| Total | 215 | 215 | ##### | 1173 | 123 | 123 | 896 | 896 | 170 | 170 | 775 | 775 |

* 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 23 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.