

Fecha de publicación: 28 de Febrero de 2005
 Fecha de Información: 24 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\$386,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	34,0	23,2	5,6	16,4	39,6
15-35	89,5	122,3	45,7	12,9	135,2
36-60	50,8	29,5	1,0	22,2	51,7
61-90	54,3	58,1	21,5	17,7	75,8
91-180	29,7	15,9	14,6	28,5	44,3
>180	32,7	9,2	7,3	30,7	40,0
Total	290,9	258,2	95,7	128,4	386,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	27	107	752	601	11	160	655	527
Real	189	25	248	378	96	17	211	362	160	11	171	299
Total	215	215	1173	1173	124	124	963	963	171	171	826	826

* 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 25 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.