

Fecha de publicación: 07 de Marzo de 2005
 Fecha de Información: 03 de Marzo 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\$276,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	56,7	79,7	44,6	21,6	101,3
15-35	45,2	69,2	51,1	27,1	96,3
36-60	34,3	26,0	5,0	13,3	39,2
61-90	13,3	12,1	0,1	1,3	13,3
91-180	10,2	8,5	1,5	3,2	11,7
>180	14,1	14,7	0,7	0,1	14,8
Total	173,7	210,1	102,9	66,6	276,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	28 de Feb. al 4 de Marzo				7 al 11 de Marzo				14 al 18 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	32	107	815	652	17	177	780	796	40	164	641	555
Real	96	22	231	394	177	17	339	323	153	29	241	328
Total	129	129	1046	1046	194	194	1119	1119	193	193	882	882

* 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 4 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.