

Fecha de publicación: 09 de Marzo de 2005
 Fecha de Información: 07 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\$356,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	74,0	87,6	50,1	36,5	124,0
15-35	104,9	79,7	49,3	74,4	154,2
36-60	46,6	24,2	8,7	31,1	55,3
61-90	5,2	11,4	6,4	0,2	11,6
91-180	0,2	7,4	7,4	0,2	7,6
>180	1,2	3,5	2,3	-	3,5
Total	232,0	214,0	124,3	142,3	356,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	7 al 11 de Marzo				14 al 18 de Marzo				21 al 25 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	28	177	834	856	43	166	717	654	6	30	217	250
Real	177	27	348	326	155	32	298	361	30	5	59	26
Total	205	205	1182	1182	198	198	1015	1015	35	35	276	276

* 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 8 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.