

Fecha de publicación: 10 de Marzo de 2005
 Fecha de Información: 08 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\$231,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	12,9	10,3	2,8	5,4	15,6
15-35	67,4	105,5	48,2	10,1	115,6
36-60	26,8	43,7	32,7	15,8	59,5
61-90	2,1	0,5	0,5	2,1	2,7
91-180	7,0	6,9	1,9	2,0	9,0
>180	24,6	24,5	4,4	4,5	29,0
Total	140,9	191,4	90,4	39,9	231,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	44	166	723	659	6	30	222	255
Real	177	28	348	326	155	33	300	364	30	5	59	26
Total	205	205	1182	1182	199	199	1023	1023	35	35	281	281

* 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 9 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.