

Fecha de publicación: 14 de Marzo de 2005
 Fecha de Información: 10 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\$225,3 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	23,4	18,3	7,3	12,4	30,7
15-35	77,9	102,4	56,4	31,9	134,4
36-60	9,7	12,0	5,0	2,7	14,7
61-90	0,4	7,9	7,9	0,4	8,2
91-180	20,0	34,6	14,6	-	34,6
>180	0,3	2,7	2,5	0,1	2,8
Total	131,6	177,9	93,7	47,5	225,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,5 %	2,4 %
15-35	1,8 %	1,9 %
36-60	2,1 %	2,3 %
61-90	2,7 %	2,8 %
91-180	3,3 %	3,3 %
>180	3,9 %	4,2 %
Total	2,2 %	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	45	170	763	679	6	30	246	266
Real	177	28	348	326	159	33	308	392	30	6	61	41
Total	205	205	1183	1183	204	204	1071	1071	35	35	307	307

* 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 11 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.