

Fecha de publicación: 15 de Marzo de 2005
 Fecha de Información: 11 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\$ 216,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	18,9	21,3	3,3	0,9	22,1
15-35	86,0	82,5	19,5	23,0	105,5
36-60	26,9	44,1	24,7	7,5	51,6
61-90	0,6	15,0	15,0	0,6	15,5
91-180	-	20,3	20,3	-	20,3
>180	0,1	1,0	1,0	0,1	1,0
Total	132,4	184,1	83,7	32,0	216,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	781	700	6	30	246	266
Real	177	28	348	326	159	34	311	392	30	6	62	41
Total	205	205	1183	1183	204	204	1092	1092	35	35	308	308

* 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 14 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.