

Fecha de publicación: 29 de Marzo de 2005
 Fecha de Información: 23 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\$134,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,7\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	29,8	48,2	27,7	9,2	57,5
15-35	37,6	31,9	23,7	29,4	61,3
36-60	5,4	5,4	0,4	0,4	5,8
61-90	0,3	0,5	0,5	0,3	0,8
91-180	-	3,4	3,4	-	3,4
>180	5,2	-	-	5,2	5,2
Total	78,2	89,5	55,8	44,5	134,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	21 al 25 de Marzo				28 de Mar. al 1 de Abril				4 al 8 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	12	30	325	314	32	153	1082	1094	18	97	552	624
Real	30	11	78	89	151	31	561	550	94	16	385	313
Total	41	41	403	403	183	183	1643	1643	112	112	937	937

* 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 24 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.