

Fecha de publicación: 03 de Febrero de 2005
 Fecha de Información: 01 de Febrero 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\$228,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	35,6	48,5	24,5	11,6	60,1
15-35	95,4	85,4	29,9	39,9	125,3
36-60	18,7	18,5	2,0	2,2	20,7
61-90	10,0	15,2	5,2	0,0	15,3
91-180	-	1,5	1,5	-	1,5
>180	5,0	3,5	0,5	2,0	5,5
Total	164,7	172,7	63,7	55,7	228,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,1 %	2,4 %
15-35	0,5 %	0,4 %
36-60	0,9 %	1,1 %
61-90	2,0 %	1,9 %
91-180	3,5 %	3,7 %
>180	4,5 %	4,0 %
Total	0,7 %	1,2 %

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	31 de Ene. al 4 de Febrero				7 al 11 de Febrero				14 al 18 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	99	188	840	951	17	204	729	510	26	53	517	473
Real	170	80	468	357	203	16	139	358	53	26	216	259
Total	269	269	1308	1308	220	220	868	868	79	79	733	733

* 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 2 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.