

Fecha de publicación: 31 de Marzo de 2005  
 Fecha de Información: 29 de Marzo de 2005 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$368,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	108,1	142,7	61,7	27,1	169,8
15-35	115,1	136,0	49,0	28,1	164,1
36-60	4,7	0,1	0,1	4,7	4,8
61-90	5,2	4,6	0,6	1,2	5,8
91-180	-	4,5	4,5	-	4,5
>180	10,5	19,0	8,5	-	19,0
<b>Total</b>	<b>243,7</b>	<b>306,9</b>	<b>124,3</b>	<b>61,1</b>	<b>368,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

**Cuadro No. 2**  
**Devaluación Implícita Anualizada**

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,2 %	1,9 %
15-35	4,3 %	4,6 %
36-60	2,8 %	3,2 %
61-90	4,1 %	4,4 %
91-180	4,8 %	4,8 %
>180	5,3 %	5,0 %
<b>Total</b>	<b>4,1 %</b>	<b>3,4 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sector	28 de Mar. al 1 de Abril				4 al 8 de Abril				11 al 15 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	37	153	1171	1146	19	97	642	721	24	114	733	636
<b>Real</b>	151	35	567	592	94	16	411	333	114	23	345	442
<b>Total</b>	188	188	1738	1738	113	113	1053	1053	138	138	1078	1078

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

<sup>3</sup> A partir del 30 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.