

Fecha de publicación: 05 de Abril de 2005  
 Fecha de Información: 01 de Abril 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\$312,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	98,7	32,0	7,0	73,7	105,7
15-35	106,4	88,9	25,9	43,4	132,3
36-60	2,1	0,5	0,3	1,9	2,4
61-90	0,8	32,5	32,5	0,8	33,3
91-180	12,0	10,5	10,5	12,0	22,5
>180	12,0	16,1	4,1	-	16,1
<b>Total</b>	<b>232,1</b>	<b>180,4</b>	<b>80,2</b>	<b>131,8</b>	<b>312,3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	9,1 %	3,6 %
15-35	9,2 %	9,4 %
36-60	4,9 %	5,1 %
61-90	4,6 %	6,6 %
91-180	4,3 %	4,7 %
>180	4,2 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>8,1 %</b>	<b>6,5 %</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**

Sectores	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	20	101	750	824	28	118	961	881
<b>Real</b>	151	35	567	592	99	17	461	387	117	27	447	527
<b>Total</b>	188	188	1738	1738	118	118	1211	1211	144	144	1408	1408

\* 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 4 de abril se presenta la proyección de vencimientos.