

Fecha de publicación: 07 de Febrero de 2005  
 Fecha de Información: 03 de Febrero 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\$101,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	32,4	14,4	3,9	21,9	36,3
15-35	29,6	24,7	12,7	17,6	42,3
36-60	2,0	4,1	4,1	2,0	6,1
61-90	1,6	0,9	0,9	1,6	2,6
91-180	10,5	3,9	3,9	10,5	14,4
>180	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>76,0</b>	<b>48,1</b>	<b>25,6</b>	<b>53,5</b>	<b>101,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,1 %	0,4 %
15-35	0,0 %	0,6 %
36-60	1,7 %	1,7 %
61-90	1,8 %	2,2 %
91-180	3,0 %	3,4 %
>180	-	-
<b>Total</b>	<b>0,8 %</b>	<b>1,0 %</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	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
<b>Financiero</b>	99	188	840	951	26	204	802	558	29	58	583	517
<b>Real</b>	170	80	468	357	203	25	141	386	58	28	218	283
<b>Total</b>	269	269	1308	1308	229	229	944	944	86	86	800	800

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 4 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.