

Fecha de publicación: 09 de Febrero de 2005  
 Fecha de Información: 07 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\$222,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,1	24,7	0,0	20,4	45,1
15-35	97,8	78,2	32,2	51,8	129,9
36-60	4,0	13,5	13,5	4,0	17,5
61-90	0,5	-	-	0,5	0,5
91-180	13,4	10,4	0,4	3,4	13,8
>180	15,4	2,1	0,1	13,4	15,5
<b>Total</b>	<b>176,3</b>	<b>128,8</b>	<b>46,1</b>	<b>93,6</b>	<b>222,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,6 %	-4,5 %
15-35	0,6 %	1,1 %
36-60	1,2 %	2,2 %
61-90	1,6 %	1,6 %
91-180	3,4 %	2,7 %
>180	4,0 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>-0,4 %</b>	<b>0,3 %</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	7 al 11 de Febrero				14 al 18 de Febrero				21 al 25 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	30	204	844	589	37	58	612	545	15	186	570	483
<b>Real</b>	203	28	148	404	58	36	219	286	185	13	221	307
<b>Total</b>	233	233	993	993	94	94	831	831	199	199	791	791

\* 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 8 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.