

Fecha de publicación: 11 de Enero de 2005  
 Fecha de Información: 09 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\$283,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	51,1	67,0	24,0	8,1	75,0
15-35	127,5	90,2	23,2	60,5	150,8
36-60	1,4	0,0	0,0	1,4	1,4
61-90	30,0	21,0	5,7	14,7	35,7
91-180	0,7	19,0	19,0	0,7	19,7
>180	0,7	0,3	0,3	0,7	1,0
<b>Total</b>	<b>211,4</b>	<b>197,5</b>	<b>72,2</b>	<b>86,1</b>	<b>283,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,9 %	6,2 %
15-35	1,6 %	2,1 %
36-60	0,6 %	0,4 %
61-90	2,1 %	2,5 %
91-180	2,2 %	3,2 %
>180	2,0 %	2,3 %
<b>Total</b>	<b>1,8 %</b>	<b>3,3 %</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	850	594	37	58	671	610	15	188	645	545
<b>Real</b>	203	29	149	405	58	37	243	304	186	13	222	321
<b>Total</b>	233	233	999	999	95	95	914	914	201	201	866	866

\* 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 10 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.