

Fecha de publicación: 14 de Enero de 2005  
 Fecha de Información: 10 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\$241,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	40,4	42,2	11,2	9,4	51,6
15-35	58,4	65,6	23,6	16,4	82,0
36-60	26,3	23,0	17,0	20,2	43,2
61-90	18,0	22,0	5,0	1,0	23,1
91-180	3,7	9,4	7,4	1,7	11,1
>180	5,0	28,0	25,4	2,3	30,3
<b>Total</b>	<b>151,7</b>	<b>190,3</b>	<b>89,5</b>	<b>51,0</b>	<b>241,3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,9 %	2,7 %
15-35	0,8 %	1,0 %
36-60	1,8 %	1,5 %
61-90	2,6 %	2,5 %
91-180	3,6 %	3,9 %
>180	4,3 %	4,6 %
<b>Total</b>	<b>2,5 %</b>	<b>2,2 %</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	38	61	698	637	16	188	659	557
<b>Real</b>	203	29	149	404	61	37	251	312	186	14	222	323
<b>Total</b>	233	233	999	999	98	98	949	949	202	202	881	881

\* 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 11 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.