

Fecha de publicación: 17 de Enero de 2005  
 Fecha de Información: 15 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\$367,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	105,5	82,1	8,6	32,0	114,1
15-35	70,0	81,7	38,2	26,5	108,2
36-60	41,3	52,3	36,1	25,1	77,4
61-90	44,3	48,6	14,6	10,3	59,0
91-180	0,6	2,0	2,0	0,6	2,6
>180	3,5	2,7	2,7	3,4	6,2
<b>Total</b>	<b>265,3</b>	<b>269,5</b>	<b>102,2</b>	<b>98,0</b>	<b>367,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,2 %	0,4 %
15-35	1,4 %	1,9 %
36-60	1,7 %	2,5 %
61-90	2,3 %	2,5 %
91-180	2,9 %	3,4 %
>180	3,5 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>1,6 %</b>	<b>1,7 %</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	14 al 18 de Febrero				21 al 25 de Febrero				28 de Feb. al 4 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	39	61	752	679	20	189	806	678	21	89	498	392
<b>Real</b>	61	39	257	330	188	18	234	362	78	11	168	273
<b>Total</b>	100	100	#####	1009	207	207	#####	1039	100	100	665	665

\* 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 16 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.