

Fecha de publicación: 23 de Febrero de 2005  
 Fecha de Información: 21 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\$207,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	70,7	54,5	1,5	17,7	72,2
15-35	45,5	46,8	25,6	24,4	71,1
36-60	26,4	14,5	9,3	21,2	35,7
61-90	3,7	1,0	1,0	3,7	4,8
91-180	5,5	6,4	5,4	4,5	10,9
>180	6,5	5,7	5,7	6,5	12,3
<b>Total</b>	<b>158,4</b>	<b>129,0</b>	<b>48,6</b>	<b>78,0</b>	<b>207,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,7 %	4,2 %
15-35	1,1 %	1,3 %
36-60	1,0 %	1,8 %
61-90	1,5 %	1,5 %
91-180	2,8 %	3,3 %
>180	3,3 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>2,0 %</b>	<b>2,6 %</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	21 al 25 de Febrero				28 de Feb. al 4 de Marzo				7 al 11 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	26	190	918	788	25	94	666	526	10	160	572	463
<b>Real</b>	189	24	246	377	83	15	203	342	160	10	128	238
<b>Total</b>	215	215	1164	1164	109	109	869	869	169	169	700	700

\* 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 22 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.