

Fecha de publicación: 1 de Marzo de 2005  
 Fecha de Información: 25 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\$317,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	52,2	61,6	31,5	22,1	83,7
15-35	62,7	70,6	30,6	22,7	93,3
36-60	21,4	41,5	29,3	9,3	50,8
61-90	15,5	11,8	9,8	13,4	25,3
91-180	25,4	20,2	9,3	14,5	34,7
>180	26,6	13,0	2,9	16,4	29,4
<b>Total</b>	<b>203,8</b>	<b>218,8</b>	<b>113,4</b>	<b>98,4</b>	<b>317,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,0 %	6,8 %
15-35	-0,3 %	1,1 %
36-60	0,1 %	-1,0 %
61-90	1,2 %	1,9 %
91-180	2,1 %	2,5 %
>180	2,8 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>1,5 %</b>	<b>2,7 %</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	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	925	795	30	107	776	628	14	160	678	562
<b>Real</b>	189	25	248	378	96	19	228	376	160	13	186	302
<b>Total</b>	215	215	1173	1173	126	126	1004	1004	173	173	865	865

\* 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 28 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.