

Fecha de publicación: 2 de Marzo de 2005  
 Fecha de Información: 28 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\$362,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	62,6	74,9	31,0	18,7	93,6
15-35	91,2	106,3	35,6	20,5	126,8
36-60	39,5	17,4	11,3	33,4	50,8
61-90	2,7	5,4	5,3	2,6	8,0
91-180	63,4	59,7	2,4	6,1	65,8
>180	15,8	1,9	1,7	15,5	17,5
<b>Total</b>	<b>275,2</b>	<b>265,6</b>	<b>87,2</b>	<b>96,7</b>	<b>362,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,3 %	-3,4 %
15-35	1,4 %	0,4 %
36-60	0,7 %	2,3 %
61-90	1,3 %	2,4 %
91-180	2,1 %	3,0 %
>180	2,8 %	2,3 %
<b>Total</b>	<b>1,7 %</b>	<b>0,3 %</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	28 de Feb. al 4 de Marzo				7 al 11 de Marzo				14 al 18 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	30	107	812	649	15	160	696	606	35	160	537	503
<b>Real</b>	96	19	228	391	160	15	212	303	149	24	226	260
<b>Total</b>	126	126	1040	1040	175	175	908	908	184	184	762	762

\* 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 1 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.