

Fecha de publicación: 22 de Marzo de 2005  
 Fecha de Información: 17 de Marzo 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\$314,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	51,8	34,5	22,5	39,8	74,2
15-35	117,0	100,2	65,9	82,7	182,9
36-60	1,2	0,1	0,1	1,2	1,3
61-90	17,8	23,2	10,1	4,7	27,9
91-180	13,5	15,0	8,0	6,5	21,5
>180	1,3	5,3	5,2	1,3	6,5
<b>Total</b>	<b>202,5</b>	<b>178,3</b>	<b>111,8</b>	<b>136,1</b>	<b>314,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,8 %	1,7 %
15-35	3,5 %	4,5 %
36-60	3,7 %	4,0 %
61-90	4,6 %	3,9 %
91-180	4,4 %	4,1 %
>180	4,2 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,7 %</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 Marzo				21 al 25 de Marzo				28 de Mar. al 1 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	47	170	825	714	12	30	325	314	27	153	999	987
<b>Real</b>	159	35	314	426	30	11	78	89	151	25	494	507
<b>Total</b>	206	206	1140	1140	41	41	403	403	178	178	1494	1494

\* 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 18 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.