

Fecha de publicación: 23 de Marzo de 2005  
 Fecha de Información: 18 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\$224,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	62,1	55,6	25,6	32,1	87,7
15-35	58,2	80,4	28,4	6,2	86,6
36-60	34,5	5,7	0,7	29,5	35,2
61-90	0,0	5,5	5,5	0,0	5,5
91-180	6,4	8,5	2,1	-	8,5
>180	0,2	0,4	0,4	0,2	0,6
<b>Total</b>	<b>161,6</b>	<b>156,1</b>	<b>62,6</b>	<b>68,1</b>	<b>224,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-4,5 %	4,0 %
15-35	2,9 %	3,8 %
36-60	4,2 %	4,1 %
61-90	4,3 %	4,1 %
91-180	4,6 %	4,2 %
>180	4,3 %	4,6 %
<b>Total</b>	<b>1,2 %</b>	<b>4,0 %</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	32	153	1056	1042
<b>Real</b>	159	35	314	426	30	11	78	89	151	30	520	534
<b>Total</b>	206	206	1140	1140	41	41	403	403	183	183	1576	1576

\* 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 21 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.