

Fecha de publicación: 30 de Marzo de 2005  
 Fecha de Información: 28 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\$331,6 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	65,4	37,5	2,2	30,0	67,6
15-35	82,2	167,4	116,4	31,2	198,6
36-60	12,8	7,1	1,1	6,8	13,9
61-90	0,0	0,6	0,6	-	0,6
91-180	-	5,7	5,7	-	5,7
>180	35,2	20,0	10,0	25,2	45,2
<b>Total</b>	<b>195,6</b>	<b>238,4</b>	<b>136,0</b>	<b>93,2</b>	<b>331,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,7 %	-17,0 %
15-35	4,3 %	5,0 %
36-60	3,8 %	1,1 %
61-90	5,7 %	5,1 %
91-180	3,7 %	4,3 %
>180	4,4 %	4,5 %
<b>Total</b>	<b>2,3 %</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 Mar. al 1 de Abril				4 al 8 de Abril				11 al 15 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	37	153	1130	1109	19	97	575	646	23	114	675	559
<b>Real</b>	151	35	561	582	94	16	387	316	113	22	301	416
<b>Total</b>	188	188	1691	1691	113	113	962	962	136	136	976	976

\* 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 29 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.