

Fecha de publicación: 04 de Febrero de 2005  
 Fecha de Información: 02 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\$277,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	93,1	53,8	0,3	39,6	93,4
15-35	55,4	116,3	64,1	3,3	119,6
36-60	3,3	5,3	3,3	1,3	6,6
61-90	28,2	17,5	4,5	15,1	32,7
91-180	0,2	1,0	1,0	0,2	1,2
>180	13,4	22,2	10,2	1,4	23,6
<b>Total</b>	<b>193,6</b>	<b>216,1</b>	<b>83,4</b>	<b>60,9</b>	<b>277,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,5 %	-4,3 %
15-35	-0,1 %	1,6 %
36-60	-0,2 %	0,4 %
61-90	1,9 %	2,2 %
91-180	2,1 %	2,3 %
>180	4,0 %	4,3 %
<b>Total</b>	<b>-0,7 %</b>	<b>-0,1 %</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	31 de Ene. al 4 de Febrero				7 al 11 de Febrero				14 al 18 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	99	188	840	951	24	204	786	546	28	58	570	515
<b>Real</b>	170	80	468	357	203	23	139	379	58	28	216	270
<b>Total</b>	269	269	1308	1308	227	227	925	925	86	86	786	786

\* 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 3 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.