

Fecha de publicación: 26 de Enero de 2004  
 Fecha de Información: 22 de Enero de 2004 <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\$82.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6.6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	23.3	22.3	2.2	3.2	25.4
15-35	15.5	13.1	2.6	5.0	18.1
36-60	1.0	1.1	1.1	1.0	2.1
61-90	5.1	5.7	0.6	-	5.7
91-180	0.1	5.3	5.3	0.1	5.4
>180	14.5	11.4	11.4	14.5	25.9
<b>Total</b>	<b>59.4</b>	<b>58.8</b>	<b>23.1</b>	<b>23.8</b>	<b>82.5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5.3 %	4.0 %
15-35	7.8 %	8.3 %
36-60	7.8 %	7.7 %
61-90	7.1 %	7.3 %
91-180	7.6 %	7.5 %
>180	7.2 %	7.6 %
<b>Total</b>	<b>7.0 %</b>	<b>6.6 %</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	19 al 23 de Enero				26 al 30 de Enero				2 al 6 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	38	38	284	191	37	54	330	320	17	53	450	279
<b>Real</b>	24	24	57	151	35	17	133	143	43	7	63	234
<b>Total</b>	62	62	341	341	72	72	463	463	60	60	513	513

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (\text{Plazo}/365)) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 23 de enero se presenta la proyección de vencimientos.