

Fecha de publicación: 30 de Enero de 2004  
 Fecha de Información: 28 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\$95.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	31.4	7.7	2.3	26.0	33.7
15-35	33.4	36.1	9.1	6.4	42.4
36-60	3.1	1.6	1.2	2.7	4.3
61-90	5.0	1.1	1.1	5.0	6.1
91-180	-	5.7	5.7	-	5.7
>180	-	3.4	3.4	-	3.4
<b>Total</b>	<b>72.8</b>	<b>55.6</b>	<b>22.8</b>	<b>40.0</b>	<b>95.6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	34.1 %	10.8 %
15-35	10.8 %	11.3 %
36-60	5.9 %	4.6 %
61-90	7.5 %	6.1 %
91-180	7.6 %	7.7 %
>180	8.1 %	7.7 %
<b>Total</b>	<b>16.7 %</b>	<b>10.1 %</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	26 al 30 de Enero				2 al 6 de Febrero				9 al 13 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	40	57	361	340	24	58	489	300	12	51	240	151
<b>Real</b>	35	18	143	164	45	11	73	262	47	9	91	180
<b>Total</b>	75	75	504	504	69	69	562	562	59	59	331	331

\* 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) ^ (Plazo/365)) - 1

<sup>3</sup> A partir del 29 de enero se presenta la proyección de vencimientos.