

Fecha de publicación: 5 de Febrero de 2004  
 Fecha de Información: 3 de Febrero 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\$70.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	10.8	21.9	14.5	3.4	25.3
15-35	20.3	15.8	1.0	5.5	21.3
36-60	11.0	1.0	1.0	11.0	12.0
61-90	0.1	0.1	0.1	0.1	0.2
91-180	2.0	2.1	0.1	-	2.1
>180	-	9.2	9.2	-	9.2
<b>Total</b>	<b>44.2</b>	<b>50.0</b>	<b>25.9</b>	<b>20.0</b>	<b>70.1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	12.8 %	7.3 %
15-35	5.7 %	6.9 %
36-60	5.8 %	5.4 %
61-90	8.1 %	8.1 %
91-180	8.3 %	6.7 %
>180	8.4 %	8.2 %
<b>Total</b>	<b>8.7 %</b>	<b>7.0 %</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	2 al 6 de Febrero				9 al 13 de Febrero				16 al 20 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	28	60	514	330	18	56	266	185	33	48	278	216
<b>Real</b>	45	13	83	267	47	10	105	186	34	19	94	156
<b>Total</b>	73	73	597	597	66	66	371	371	67	67	372	372

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

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

<sup>3</sup> A partir del 4 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.