

Fecha de publicación: 9 de Febrero de 2004  
 Fecha de Información: 5 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\$108.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6.7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.8	-	-	2.8	2.8
15-35	59.6	48.0	3.0	14.6	62.6
36-60	8.0	8.1	3.1	3.0	11.1
61-90	19.4	15.4	0.4	4.4	19.8
91-180	5.0	4.3	2.3	3.0	7.3
>180	5.0	5.0	-	-	5.0
<b>Total</b>	<b>99.8</b>	<b>80.8</b>	<b>8.8</b>	<b>27.8</b>	<b>108.6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3.4 %	0.9 %
15-35	6.4 %	7.1 %
36-60	7.0 %	6.1 %
61-90	6.4 %	5.9 %
91-180	8.3 %	7.7 %
>180	8.8 %	8.8 %
<b>Total</b>	<b>6.2 %</b>	<b>6.7 %</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	22	56	309	212	34	48	283	217
<b>Real</b>	45	13	83	267	47	14	107	203	34	20	95	161
<b>Total</b>	73	73	597	597	69	69	416	416	67	67	378	378

\* 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 6 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.