

Fecha de publicación: 14 de Febrero de 2004  
 Fecha de Información: 12 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\$137.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	42.3	26.0	5.0	21.3	47.3
15-35	27.3	14.5	9.0	21.8	36.3
36-60	5.0	11.0	6.0	0.0	11.0
61-90	5.0	0.2	0.2	5.0	5.2
91-180	31.7	12.0	0.8	20.5	32.5
>180	2.0	2.8	2.8	2.0	4.8
<b>Total</b>	<b>113.3</b>	<b>66.4</b>	<b>23.7</b>	<b>70.6</b>	<b>137.1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6.1 %	6.9 %
15-35	6.7 %	6.7 %
36-60	7.7 %	8.5 %
61-90	5.0 %	6.8 %
91-180	7.9 %	7.6 %
>180	8.2 %	8.1 %
<b>Total</b>	<b>6.9 %</b>	<b>7.2 %</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	9 al 13 de Febrero				16 al 20 de Febrero				23 al 27 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	23	57	337	255	49	56	353	272	14	31	234	201
<b>Real</b>	49	15	133	215	34	27	99	180	28	11	90	123
<b>Total</b>	71	71	469	469	83	83	452	452	42	42	324	324

\* 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 13 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.