

Fecha de publicación: 3 de Marzo de 2004  
 Fecha de Información: 1 de Marzo 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\$112.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	28.3	-	-	28.3	28.3
15-35	48.3	40.1	5.9	14.1	54.2
36-60	8.0	8.0	0.0	-	8.0
61-90	12.0	13.0	1.0	-	13.0
91-180	3.6	4.0	4.0	3.6	7.5
>180	-	1.9	1.9	-	1.9
<b>Total</b>	<b>100.1</b>	<b>67.0</b>	<b>12.8</b>	<b>45.9</b>	<b>112.9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0.9 %	1.9 %
15-35	6.1 %	6.0 %
36-60	8.2 %	4.8 %
61-90	7.3 %	7.7 %
91-180	8.2 %	7.3 %
>180	7.5 %	7.9 %
<b>Total</b>	<b>6.3 %</b>	<b>5.2 %</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	1 al 5 de Marzo				8 al 12 de Marzo				15 al 19 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	16	33	250	179	21	24	301	225	25	62	430	390
<b>Real</b>	28	10	59	129	22	18	56	132	59	21	129	170
<b>Total</b>	43	43	308	308	42	42	357	357	84	84	560	560

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

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

<sup>3</sup> A partir del 2 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.