

Fecha de publicación: 4 de Marzo de 2004  
 Fecha de Información: 2 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\$96.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6.0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.7	3.6	0.6	0.7	4.3
15-35	57.5	51.1	8.6	15.0	66.1
36-60	5.0	5.6	0.6	-	5.6
61-90	0.4	1.1	1.1	0.4	1.6
91-180	1.1	14.6	14.6	1.1	15.7
>180	1.0	2.8	1.8	-	2.8
<b>Total</b>	<b>68.8</b>	<b>78.7</b>	<b>27.2</b>	<b>17.3</b>	<b>96.0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0.6 %	-0.2 %
15-35	6.0 %	5.9 %
36-60	6.5 %	5.7 %
61-90	6.6 %	6.8 %
91-180	7.2 %	7.8 %
>180	7.6 %	8.1 %
<b>Total</b>	<b>5.7 %</b>	<b>6.0 %</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	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	253	182	21	24	301	225	25	62	434	393
<b>Real</b>	28	10	59	129	22	19	57	132	59	21	131	173
<b>Total</b>	43	43	311	311	43	43	358	358	84	84	565	565

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

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