

Fecha de publicación: 7 de Abril de 2004  
 Fecha de Información: 5 de Abril 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\$80.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3.3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.5	15.8	10.3	2.0	17.8
15-35	39.8	28.0	6.0	17.8	45.8
36-60	10.0	5.1	0.1	5.0	10.1
61-90	0.5	0.5	-	-	0.5
91-180	-	0.9	0.9	-	0.9
>180	3.1	5.2	2.2	0.1	5.3
<b>Total</b>	<b>60.9</b>	<b>55.5</b>	<b>19.5</b>	<b>24.9</b>	<b>80.4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1.6 %	1.8 %
15-35	3.5 %	3.3 %
36-60	4.9 %	3.9 %
61-90	4.3 %	4.3 %
91-180	6.4 %	6.3 %
>180	6.8 %	6.9 %
<b>Total</b>	<b>4.0 %</b>	<b>3.3 %</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	5 al 9 de Abril				12 al 16 de Abril				19 al 23 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	17	26	348	282	25	82	496	385	11	20	289	241
<b>Real</b>	22	13	42	108	70	13	91	202	19	10	90	139
<b>Total</b>	38	38	391	391	95	95	587	587	30	30	380	380

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