

Fecha de publicación: 13 de Abril de 2004  
 Fecha de Información: 7 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\$64.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	11.3	8.9	1.9	4.3	13.3
15-35	22.0	40.6	18.6	0.0	40.6
36-60	8.8	8.0	-	0.8	8.8
61-90	1.0	0.0	0.0	1.0	1.0
91-180	-	0.1	0.1	-	0.1
>180	1.0	1.0	-	-	1.0
<b>Total</b>	<b>44.2</b>	<b>58.7</b>	<b>20.7</b>	<b>6.2</b>	<b>64.9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	16.4 %	15.4 %
15-35	2.5 %	2.9 %
36-60	5.8 %	5.6 %
61-90	9.5 %	5.2 %
91-180	8.1 %	8.3 %
>180	7.6 %	7.6 %
<b>Total</b>	<b>7.1 %</b>	<b>5.9 %</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	26	86	500	388	11	20	323	290
<b>Real</b>	22	13	42	108	75	15	92	205	19	10	105	139
<b>Total</b>	38	38	391	391	101	101	592	592	30	30	429	429

\* 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 8 de abril se presenta la proyección de vencimientos.