

Fecha de publicación: 16 de Abril de 2004  
 Fecha de Información: 14 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\$88.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2.1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	18.2	15.8	2.2	4.6	20.4
15-35	43.7	53.3	9.7	0.1	53.4
36-60	-	1.2	1.2	-	1.2
61-90	-	1.9	1.9	-	1.9
91-180	1.0	5.4	4.4	-	5.4
>180	3.1	5.9	2.9	0.1	6.0
<b>Total</b>	<b>66.0</b>	<b>83.5</b>	<b>22.2</b>	<b>4.8</b>	<b>88.3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-5.6 %	-5.5 %
15-35	3.3 %	4.1 %
36-60	4.5 %	5.4 %
61-90	4.4 %	3.6 %
91-180	6.4 %	5.5 %
>180	6.6 %	5.8 %
<b>Total</b>	<b>3.4 %</b>	<b>2.1 %</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	12 al 16 de Abril				19 al 23 de Abril				26 al 30 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	26	86	582	425	19	31	366	324	10	44	175	182
<b>Real</b>	75	15	94	252	29	17	113	155	36	2	56	49
<b>Total</b>	101	101	676	676	48	48	479	479	46	46	230	230

\* 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 15 de abril se presenta la proyección de vencimientos.