

Fecha de publicación: 20 de Abril de 2004  
 Fecha de Información: 16 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\$153.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3.4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24.9	14.2	2.2	12.9	27.1
15-35	41.3	58.5	22.5	5.3	63.8
36-60	1.0	21.9	20.9	-	21.9
61-90	13.0	17.1	11.1	7.0	24.1
91-180	3.0	10.8	7.8	-	10.8
>180	6.1	6.1	0.1	0.1	6.2
<b>Total</b>	<b>89.2</b>	<b>128.6</b>	<b>64.6</b>	<b>25.2</b>	<b>153.8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	15.8 %	1.8 %
15-35	2.8 %	2.8 %
36-60	3.5 %	3.6 %
61-90	4.8 %	4.6 %
91-180	6.3 %	5.9 %
>180	6.6 %	6.7 %
<b>Total</b>	<b>6.2 %</b>	<b>3.4 %</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	21	38	376	327	11	46	194	194
<b>Real</b>	75	15	94	252	35	17	116	165	36	2	56	56
<b>Total</b>	101	101	676	676	55	55	492	492	48	48	250	250

\* 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 19 de abril se presenta la proyección de vencimientos.