

Fecha de publicación: 28 de Abril de 2004  
 Fecha de Información: 26 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\$150,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	35,2	25,2	8,2	18,2	43,4
15-35	42,0	42,3	3,3	3,0	45,3
36-60	24,0	16,9	0,9	8,0	24,9
61-90	30,0	30,1	0,1	-	30,1
91-180	5,0	1,8	1,8	5,0	6,8
>180	-	0,5	0,5	-	0,5
<b>Total</b>	<b>136,2</b>	<b>116,7</b>	<b>14,7</b>	<b>34,2</b>	<b>150,9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	12,2 %	16,3 %
15-35	1,7 %	1,0 %
36-60	4,3 %	2,8 %
61-90	4,1 %	3,5 %
91-180	6,1 %	5,3 %
>180	6,8 %	6,7 %
<b>Total</b>	<b>5,0 %</b>	<b>6,4 %</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	26 al 30 de Abril				3 al 7 de Mayo				10 al 14 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	18	63	279	248	15	36	361	302	16	34	247	186
<b>Real</b>	51	5	86	117	33	12	81	140	28	11	47	108
<b>Total</b>	68	68	365	365	49	49	442	442	45	45	294	294

\* 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 27 de abril se presenta la proyección de vencimientos.