

Fecha de publicación: 30 de Marzo de 2004  
 Fecha de Información: 26 de Marzo 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\$92.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6.0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	18.8	12.6	7.6	13.8	26.4
15-35	47.1	34.4	8.4	21.1	55.5
36-60	-	2.2	2.2	-	2.2
61-90	1.5	0.7	0.7	1.5	2.2
91-180	-	5.7	5.7	-	5.7
>180	-	0.3	0.3	-	0.3
<b>Total</b>	<b>67.4</b>	<b>55.9</b>	<b>24.9</b>	<b>36.4</b>	<b>92.4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3.4 %	4.9 %
15-35	5.9 %	6.3 %
36-60	6.2 %	6.1 %
61-90	6.9 %	6.8 %
91-180	7.4 %	7.2 %
>180	7.8 %	7.8 %
<b>Total</b>	<b>5.5 %</b>	<b>6.0 %</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	22 al 26 de Marzo				29 de Mar. al 2 de Abril				5 al 9 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	11	45	352	261	71	93	424	520	6	14	271	218
<b>Real</b>	39	6	38	129	32	10	205	109	11	3	25	78
<b>Total</b>	50	50	390	390	103	103	629	629	17	17	296	296

\* 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 29 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.