

Fecha de publicación: 31 de Marzo de 2004  
 Fecha de Información: 29 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\$117.8 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	45.4	47.5	13.0	10.9	58.3
15-35	52.7	50.9	1.9	3.7	54.6
36-60	1.0	1.0	-	-	1.0
61-90	-	0.0	0.0	-	0.0
91-180	3.1	3.8	0.7	-	3.8
>180	-	0.0	0.0	-	0.0
<b>Total</b>	<b>102.2</b>	<b>103.2</b>	<b>15.6</b>	<b>14.6</b>	<b>117.8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5.5 %	6.0 %
15-35	5.8 %	5.7 %
36-60	5.7 %	5.7 %
61-90	7.6 %	7.6 %
91-180	5.5 %	7.1 %
>180	8.6 %	8.6 %
<b>Total</b>	<b>5.7 %</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**

Sector	29 de Mar. al 2 de Abril				5 al 9 de Abril				12 al 16 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	72	98	451	550	6	20	288	225	19	39	390	312
<b>Real</b>	37	11	207	109	17	3	25	88	28	8	78	156
<b>Total</b>	109	109	658	658	23	23	313	313	47	47	467	467

\* 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 30 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.