

Fecha de publicación: 1 de Abril de 2004  
 Fecha de Información: 30 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\$87.1 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	32.2	21.7	6.0	16.5	38.2
15-35	35.0	34.0	2.0	3.0	37.0
36-60	5.0	5.5	0.5	-	5.5
61-90	1.0	1.0	-	-	1.0
91-180	-	0.7	0.7	-	0.7
>180	3.1	4.7	1.7	0.1	4.8
<b>Total</b>	<b>76.3</b>	<b>67.5</b>	<b>10.8</b>	<b>19.6</b>	<b>87.1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4.6 %	6.2 %
15-35	5.7 %	6.3 %
36-60	6.9 %	7.3 %
61-90	5.9 %	5.9 %
91-180	4.5 %	6.9 %
>180	8.3 %	8.0 %
<b>Total</b>	<b>5.8 %</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	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>	74	98	453	550	15	20	307	241	19	45	406	328
<b>Real</b>	37	13	207	111	17	12	25	91	34	8	78	156
<b>Total</b>	111	111	660	660	31	31	332	332	53	53	483	483

\* 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 31 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.