

Fecha de publicación: 29 de Abril de 2004  
 Fecha de Información: 27 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\$71,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	52,1	6,8	0,8	46,1	52,9
15-35	13,2	10,9	0,4	2,7	13,6
36-60	-	0,4	0,4	-	0,4
61-90	0,0	0,9	0,9	-	0,9
91-180	2,1	2,5	1,4	1,0	3,5
>180	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>67,4</b>	<b>21,5</b>	<b>3,9</b>	<b>49,8</b>	<b>71,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,7 %	-0,1 %
15-35	2,6 %	2,4 %
36-60	3,7 %	3,7 %
61-90	7,1 %	6,2 %
91-180	5,4 %	4,6 %
>180	-	-
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>0,7 %</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	64	301	250	16	36	391	307	16	34	256	193
<b>Real</b>	51	5	87	137	33	13	81	165	28	11	47	110
<b>Total</b>	69	69	387	387	49	49	472	472	45	45	303	303

\* 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 28 de abril se presenta la proyección de vencimientos.