

Fecha de publicación: 6 de Julio de 2004  
 Fecha de Información: 1 de Julio 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\$245,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	75,2	47,7	0,6	28,1	75,8
15-35	86,0	53,4	4,4	37,0	90,4
36-60	9,6	6,7	3,6	6,5	13,2
61-90	27,3	8,0	0,7	20,0	28,0
91-180	15,0	2,8	2,8	15,0	17,8
>180	-	20,1	20,1	-	20,1
<b>Total</b>	<b>213,0</b>	<b>138,6</b>	<b>32,2</b>	<b>106,6</b>	<b>245,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,9 %	5,0 %
15-35	2,8 %	1,9 %
36-60	4,9 %	4,6 %
61-90	5,2 %	4,4 %
91-180	5,9 %	4,6 %
>180	6,8 %	6,9 %
<b>Total</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,9 %</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**

Sectores	28 de Jun. al 2 de Julio				5 al 9 de Julio				12 al 16 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	83	89	492	440	26	58	344	206	15	41	369	310
<b>Real</b>	76	71	115	167	46	14	33	171	32	6	79	138
<b>Total</b>	160	160	607	607	72	72	377	377	47	47	448	448

\* 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 2 de julio se presenta la proyección de vencimientos.