

Fecha de publicación: 16 de Julio de 2004  
 Fecha de Información: 14 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\$195,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	63,8	73,3	26,3	16,8	90,1
15-35	25,1	25,8	7,7	7,0	32,8
36-60	8,3	11,4	3,1	-	11,4
61-90	47,1	13,1	6,0	40,0	53,1
91-180	0,1	6,2	6,1	-	6,2
>180	1,5	2,2	0,7	-	2,2
<b>Total</b>	<b>145,9</b>	<b>132,0</b>	<b>49,9</b>	<b>63,8</b>	<b>195,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,6 %	1,3 %
15-35	2,7 %	1,0 %
36-60	3,9 %	4,4 %
61-90	4,6 %	4,3 %
91-180	5,8 %	5,8 %
>180	6,6 %	6,5 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>2,4 %</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	12 al 16 de Julio				19 al 23 de Julio				26 al 30 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	20	54	519	417	6	34	413	257	14	61	219	246
<b>Real</b>	45	11	93	196	31	3	55	211	50	3	107	80
<b>Total</b>	66	66	612	612	37	37	468	468	64	64	326	326

\* 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 15 de julio se presenta la proyección de vencimientos.