

Fecha de publicación: 29 de Julio de 2004  
 Fecha de Información: 27 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\$172,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,7	39,0	14,0	13,7	52,7
15-35	59,7	69,0	27,3	18,0	87,0
36-60	3,0	3,4	1,4	1,0	4,4
61-90	12,6	9,4	1,0	4,2	13,6
91-180	-	7,4	7,4	-	7,4
>180	6,8	0,3	0,3	6,8	7,1
<b>Total</b>	<b>120,9</b>	<b>128,4</b>	<b>51,3</b>	<b>43,8</b>	<b>172,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,9 %	4,5 %
15-35	3,6 %	3,2 %
36-60	4,2 %	4,1 %
61-90	4,5 %	4,6 %
91-180	6,3 %	5,9 %
>180	6,6 %	6,6 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>4,0 %</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 Julio				2 al 6 de Agosto				9 al 13 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	31	69	382	338	5	52	330	295	6	89	227	236
<b>Real</b>	53	15	122	165	50	4	92	127	87	4	87	77
<b>Total</b>	84	84	503	503	56	56	423	423	93	93	313	313

\* 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 julio se presenta la proyección de vencimientos.