

Fecha de publicación: 5 de Mayo de 2004  
 Fecha de Información: 3 de Mayo 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\$175,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	62,6	86,5	30,0	6,1	92,6
15-35	53,2	51,7	14,0	15,5	67,2
36-60	5,3	3,0	0,0	2,3	5,3
61-90	0,2	0,3	0,3	0,2	0,5
91-180	6,0	-	-	6,0	6,0
>180	3,5	-	-	3,5	3,5
<b>Total</b>	<b>130,7</b>	<b>141,5</b>	<b>44,3</b>	<b>33,5</b>	<b>175,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,0 %	13,2 %
15-35	3,6 %	4,6 %
36-60	3,9 %	4,6 %
61-90	4,6 %	4,6 %
91-180	5,8 %	6,2 %
>180	6,7 %	6,8 %
<b>Total</b>	<b>3,9 %</b>	<b>9,2 %</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	3 al 7 de Mayo				10 al 14 de Mayo				17 al 21 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	31	40	564	477	23	34	309	244	25	50	482	416
<b>Real</b>	34	25	132	219	28	17	69	134	43	18	123	189
<b>Total</b>	65	65	696	696	51	51	379	379	68	68	604	604

\* 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 4 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.