

Fecha de publicación: 6 de Mayo de 2004  
 Fecha de Información: 4 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\$182,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	61,2	39,2	0,2	22,2	61,4
15-35	74,2	78,9	21,8	17,1	96,0
36-60	5,6	6,2	1,2	0,6	6,8
61-90	-	13,5	13,5	-	13,5
91-180	-	1,5	1,5	-	1,5
>180	2,0	3,0	1,0	-	3,0
<b>Total</b>	<b>143,0</b>	<b>142,4</b>	<b>39,3</b>	<b>39,9</b>	<b>182,3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,4 %	5,8 %
15-35	4,7 %	5,4 %
36-60	5,2 %	5,3 %
61-90	6,8 %	7,4 %
91-180	7,4 %	7,2 %
>180	8,2 %	7,3 %
<b>Total</b>	<b>6,0 %</b>	<b>5,7 %</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	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	587	500	24	34	320	249	25	50	519	453
<b>Real</b>	34	25	132	219	28	19	69	140	43	18	139	205
<b>Total</b>	65	65	719	719	52	52	389	389	68	68	658	658

\* 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 5 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.