

Fecha de publicación: 11 de Mayo de 2004  
 Fecha de Información: 7 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\$230,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	65,8	93,7	36,9	9,0	102,7
15-35	85,4	85,0	13,0	13,4	98,4
36-60	6,6	8,8	3,8	1,6	10,4
61-90	5,5	7,6	2,6	0,5	8,1
91-180	3,0	0,0	0,0	3,0	3,1
>180	7,1	0,4	0,4	7,1	7,5
<b>Total</b>	<b>173,4</b>	<b>195,5</b>	<b>56,7</b>	<b>34,6</b>	<b>230,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,1 %	3,8 %
15-35	6,1 %	7,6 %
36-60	6,4 %	7,7 %
61-90	7,2 %	7,7 %
91-180	7,1 %	7,3 %
>180	10,4 %	7,9 %
<b>Total</b>	<b>5,7 %</b>	<b>5,9 %</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	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	30	86	387	310	32	51	634	580
<b>Real</b>	34	25	132	219	81	25	86	164	43	24	161	214
<b>Total</b>	65	65	719	719	111	111	473	473	75	75	795	795

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

<sup>3</sup> A partir del 10 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.