

Fecha de publicación: 27 de Mayo de 2004  
 Fecha de Información: 25 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\$176,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	48,4	46,0	12,1	14,6	60,5
15-35	66,9	71,7	9,7	4,9	76,6
36-60	14,0	13,8	2,8	3,0	16,8
61-90	0,2	2,9	2,7	-	2,9
91-180	0,4	9,3	8,9	-	9,3
>180	6,5	5,8	3,8	4,5	10,3
<b>Total</b>	<b>136,4</b>	<b>149,4</b>	<b>40,0</b>	<b>27,0</b>	<b>176,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,4 %	6,2 %
15-35	7,8 %	8,6 %
36-60	7,0 %	7,3 %
61-90	7,3 %	7,4 %
91-180	7,2 %	6,9 %
>180	7,2 %	7,1 %
<b>Total</b>	<b>7,4 %</b>	<b>7,4 %</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**

Sector	24 al 28 de Mayo				31 de May. al 4 de Junio				7 al 11 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	16	46	345	330	26	63	439	370	29	31	310	256
<b>Real</b>	44	13	115	130	58	20	91	160	16	13	97	151
<b>Total</b>	59	59	460	460	83	83	530	530	45	45	407	407

\* 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 26 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.