

Fecha de publicación: 1 de Junio de 2004  
 Fecha de Información: 28 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\$178,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	71,2	75,8	9,7	5,2	80,9
15-35	46,8	35,2	13,1	24,7	59,9
36-60	0,1	4,2	4,1	-	4,2
61-90	5,0	6,4	1,4	-	6,4
91-180	4,5	3,8	3,3	4,0	7,8
>180	11,3	10,2	8,2	9,3	19,5
<b>Total</b>	<b>138,8</b>	<b>135,6</b>	<b>39,9</b>	<b>43,1</b>	<b>178,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,7 %	7,9 %
15-35	5,8 %	5,9 %
36-60	6,7 %	7,2 %
61-90	7,2 %	6,6 %
91-180	7,5 %	7,2 %
>180	7,1 %	7,1 %
<b>Total</b>	<b>6,9 %</b>	<b>7,0 %</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	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	33	68	542	461	31	33	347	292
<b>Real</b>	44	13	115	130	58	23	101	183	17	15	105	159
<b>Total</b>	59	59	460	460	91	91	644	644	48	48	451	451

\* 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 31 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.