

**Fecha de publicación: 22 de Junio de 2004**  
**Fecha de Información: 17 de Junio 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\$165,1 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	38,9	34,3	9,3	13,9	48,2
15-35	73,5	30,1	5,1	48,5	78,6
36-60	3,2	5,0	1,8	-	5,0
61-90	2,0	5,4	3,4	-	5,4
91-180	5,0	19,6	14,6	-	19,6
>180	4,3	3,9	3,9	4,3	8,2
<b>Total</b>	<b>126,8</b>	<b>98,4</b>	<b>38,2</b>	<b>66,6</b>	<b>165,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	10,3 %	5,6 %
15-35	6,2 %	5,7 %
36-60	6,8 %	6,5 %
61-90	6,9 %	6,5 %
91-180	7,0 %	7,0 %
>180	6,9 %	7,0 %
<b>Total</b>	<b>7,6 %</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	14 al 18 de Junio				21 al 25 de Junio				28 de Jun. al 2 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	65	75	348	375	27	74	365	291	19	31	352	314
<b>Real</b>	39	29	163	136	61	14	44	118	25	13	110	148
<b>Total</b>	104	104	510	510	88	88	408	408	44	44	462	462

\* 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 18 de junio se presenta la proyección de vencimientos.