

**Fecha de publicación: 30 de Junio de 2004**  
**Fecha de Información: 28 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\$92,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	49,1	28,8	2,8	23,1	51,9
15-35	12,8	5,1	2,8	10,5	15,6
36-60	-	1,9	1,9	-	1,9
61-90	-	1,7	1,7	-	1,7
91-180	7,0	14,4	7,4	-	14,4
>180	5,0	6,8	1,8	-	6,8
<b>Total</b>	<b>73,9</b>	<b>58,7</b>	<b>18,4</b>	<b>33,7</b>	<b>92,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,6 %	4,0 %
15-35	6,7 %	5,3 %
36-60	7,8 %	7,5 %
61-90	7,5 %	7,5 %
91-180	6,8 %	6,4 %
>180	6,8 %	7,0 %
<b>Total</b>	<b>7,2 %</b>	<b>5,0 %</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	28 de Jun. al 2 de Julio				5 al 9 de Julio				12 al 16 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	83	89	491	440	3	46	258	156	13	40	306	273
<b>Real</b>	76	71	115	167	45	3	31	134	31	3	74	107
<b>Total</b>	160	160	606	606	49	49	290	290	44	44	380	380

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

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

<sup>3</sup> A partir del 29 de junio se presenta la proyección de vencimientos.