

Fecha de publicación: 30 de Julio de 2004  
 Fecha de Información: 28 de Julio 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\$143,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6,4	27,8	25,0	3,6	31,4
15-35	58,3	63,4	24,0	18,9	82,3
36-60	8,4	8,8	0,4	-	8,8
61-90	7,0	8,3	1,3	-	8,3
91-180	-	8,4	8,4	-	8,4
>180	2,8	0,9	0,9	2,8	3,7
<b>Total</b>	<b>82,9</b>	<b>117,6</b>	<b>60,1</b>	<b>25,3</b>	<b>143,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,0 %	13,0 %
15-35	3,6 %	3,0 %
36-60	3,8 %	4,0 %
61-90	5,9 %	5,4 %
91-180	6,5 %	6,5 %
>180	6,9 %	6,7 %
<b>Total</b>	<b>4,9 %</b>	<b>5,7 %</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	26 al 30 de Julio				2 al 6 de Agosto				9 al 13 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	31	69	382	338	6	52	334	323	7	89	230	238
<b>Real</b>	53	15	122	165	51	4	117	129	87	5	87	78
<b>Total</b>	84	84	503	503	56	56	452	452	94	94	316	316

\* 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 29 de julio se presenta la proyección de vencimientos.