

Fecha de publicación: 30 de Agosto de 2004  
 Fecha de Información: 26 de Agosto 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\$216,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	33,9	34,1	28,0	27,8	62,0
15-35	94,5	83,5	33,3	44,3	127,8
36-60	9,7	15,3	5,6	-	15,3
61-90	-	0,5	0,5	-	0,5
91-180	2,0	6,4	4,4	-	6,4
>180	0,1	4,3	4,3	0,1	4,5
<b>Total</b>	<b>140,3</b>	<b>144,2</b>	<b>76,1</b>	<b>72,2</b>	<b>216,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,1 %	2,7 %
15-35	3,9 %	3,4 %
36-60	5,1 %	5,0 %
61-90	6,1 %	5,6 %
91-180	6,2 %	5,9 %
>180	6,6 %	7,0 %
<b>Total</b>	<b>4,7 %</b>	<b>3,5 %</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	23 al 27 de Agosto				30 de Ago. al 3 de Septiembre				6 al 10 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	14	112	393	305	11	89	464	427	12	88	548	358
<b>Real</b>	108	11	93	180	87	10	112	150	85	8	50	240
<b>Total</b>	123	123	486	486	98	98	577	577	96	96	598	598

\* 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 27 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.