

Fecha de publicación: 12 de Agosto de 2004  
 Fecha de Información: 10 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\$273,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	27,0	34,7	15,4	7,7	42,5
15-35	62,4	49,5	8,5	21,4	70,9
36-60	7,6	7,0	3,3	4,0	11,0
61-90	14,1	15,0	1,0	0,1	15,1
91-180	10,0	16,4	8,4	2,0	18,4
>180	86,0	35,4	29,4	80,0	115,4
<b>Total</b>	<b>207,2</b>	<b>158,0</b>	<b>66,0</b>	<b>115,2</b>	<b>273,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,6 %	5,3 %
15-35	4,7 %	4,5 %
36-60	5,4 %	5,2 %
61-90	5,2 %	4,3 %
91-180	6,7 %	6,5 %
>180	6,8 %	6,0 %
<b>Total</b>	<b>6,0 %</b>	<b>5,4 %</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	9 al 13 de Agosto				16 al 20 de Agosto				23 al 27 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	12	93	330	328	13	48	392	336	7	70	251	228
<b>Real</b>	91	10	108	110	48	12	103	158	66	3	89	113
<b>Total</b>	103	103	438	438	61	61	495	495	73	73	340	340

\* 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 11 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.