

Fecha de publicación: 18 de Agosto de 2004  
 Fecha de Información: 13 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\$191,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	68,9	71,2	36,2	33,9	105,1
15-35	34,2	43,0	22,0	13,2	56,2
36-60	0,2	15,3	15,3	0,2	15,4
61-90	8,1	5,1	0,1	3,1	8,2
91-180	4,3	2,4	2,4	4,3	6,8
>180	-	0,1	0,1	-	0,1
<b>Total</b>	<b>115,7</b>	<b>137,2</b>	<b>76,2</b>	<b>54,7</b>	<b>191,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,9 %	4,0 %
15-35	3,8 %	4,1 %
36-60	4,2 %	3,5 %
61-90	5,5 %	5,7 %
91-180	6,4 %	5,3 %
>180	6,5 %	6,5 %
<b>Total</b>	<b>4,2 %</b>	<b>4,1 %</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**

Sector	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	37	67	531	499	10	93	330	264
<b>Real</b>	91	10	108	110	66	36	143	175	89	7	91	157
<b>Total</b>	103	103	438	438	103	103	674	674	100	100	421	421

\* 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 16 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.