

Fecha de publicación: 25 de Agosto de 2004  
 Fecha de Información: 23 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\$145,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,3	24,0	-	14,3	38,3
15-35	64,4	56,7	18,2	25,9	82,6
36-60	3,3	1,5	1,2	3,0	4,5
61-90	-	0,2	0,2	-	0,2
91-180	5,3	10,2	6,2	1,3	11,5
>180	1,2	7,0	7,0	1,2	8,2
<b>Total</b>	<b>112,6</b>	<b>99,7</b>	<b>32,9</b>	<b>45,8</b>	<b>145,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,4 %	2,9 %
15-35	4,0 %	3,8 %
36-60	5,1 %	4,5 %
61-90	6,5 %	6,2 %
91-180	6,1 %	5,7 %
>180	6,6 %	6,6 %
<b>Total</b>	<b>4,4 %</b>	<b>3,9 %</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	113	393	305	8	72	431	393	8	41	380	335
<b>Real</b>	109	11	92	180	71	7	105	143	37	5	50	94
<b>Total</b>	124	124	485	485	79	79	536	536	45	45	429	429

\* 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 24 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.