

Fecha de publicación: 26 de Agosto de 2004  
 Fecha de Información: 24 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\$189,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	22,3	19,1	5,1	8,3	27,4
15-35	98,0	95,7	16,2	18,5	114,2
36-60	0,1	3,8	3,8	0,1	3,9
61-90	15,3	19,5	4,5	0,3	19,8
91-180	7,6	20,5	15,5	2,6	23,1
>180	-	1,1	1,1	-	1,1
<b>Total</b>	<b>143,4</b>	<b>159,7</b>	<b>46,2</b>	<b>29,9</b>	<b>189,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,9 %	4,2 %
15-35	3,9 %	3,9 %
36-60	4,9 %	4,9 %
61-90	5,1 %	5,0 %
91-180	6,3 %	5,7 %
>180	6,8 %	7,1 %
<b>Total</b>	<b>4,9 %</b>	<b>4,3 %</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	451	412	8	41	391	335
<b>Real</b>	109	11	92	180	71	7	110	150	37	5	50	106
<b>Total</b>	124	124	485	485	80	80	562	562	45	45	441	441

\* 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 25 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.