

Fecha de publicación: 1 de Septiembre de 2004  
 Fecha de Información: 30 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\$210,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	32,5	19,1	0,1	13,5	32,7
15-35	70,4	94,6	71,7	47,5	142,1
36-60	10,4	20,6	10,3	0,1	20,7
61-90	0,8	1,2	0,8	0,4	1,6
91-180	1,4	10,8	10,3	0,9	11,7
>180	-	1,5	1,5	-	1,5
<b>Total</b>	<b>115,6</b>	<b>148,0</b>	<b>94,8</b>	<b>62,4</b>	<b>210,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	23,1 %	11,2 %
15-35	2,9 %	2,7 %
36-60	7,2 %	5,5 %
61-90	4,4 %	5,0 %
91-180	5,2 %	5,6 %
>180	6,7 %	6,7 %
<b>Total</b>	<b>6,7 %</b>	<b>4,5 %</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	30 de Ago. al 3 de Sept				6 al 10 de Sept				13 al 17 de Sept			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	27	105	472	435	12	89	568	363	17	171	302	144
<b>Real</b>	88	10	113	150	86	9	55	260	159	6	46	204
<b>Total</b>	115	115	584	584	98	98	623	623	176	176	347	347

\* 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 31 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.