

Fecha de publicación: 6 de Septiembre de 2004  
 Fecha de Información: 2 de Septiembre 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\$311,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,9	18,1	13,1	39,9	58,0
15-35	162,3	119,7	31,7	74,3	194,0
36-60	0,3	5,2	5,1	0,2	5,4
61-90	19,3	36,1	16,8	-	36,1
91-180	4,7	4,5	4,3	4,5	9,0
>180	5,0	8,5	3,5	-	8,5
<b>Total</b>	<b>236,5</b>	<b>192,2</b>	<b>74,6</b>	<b>118,9</b>	<b>311,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-4,6 %	-8,6 %
15-35	3,3 %	2,4 %
36-60	3,5 %	4,6 %
61-90	5,5 %	4,6 %
91-180	6,3 %	5,6 %
>180	6,9 %	6,5 %
<b>Total</b>	<b>2,4 %</b>	<b>0,8 %</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	26	94	625	417	20	179	358	180
<b>Real</b>	88	10	113	150	86	17	69	277	168	9	65	243
<b>Total</b>	115	115	585	585	111	111	694	694	188	188	422	422

\* 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 3 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.