

Fecha de publicación: 9 de Septiembre de 2004  
 Fecha de Información: 7 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\$335,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	149,4	114,3	16,3	51,4	165,7
15-35	81,5	78,0	46,0	49,5	127,5
36-60	10,0	0,5	0,5	10,0	10,5
61-90	13,2	13,9	0,7	-	13,9
91-180	0,2	3,8	3,6	-	3,8
>180	10,2	3,4	3,4	10,2	13,6
<b>Total</b>	<b>264,6</b>	<b>213,8</b>	<b>70,4</b>	<b>121,1</b>	<b>335,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,6 %	3,1 %
15-35	4,2 %	3,9 %
36-60	4,2 %	3,1 %
61-90	4,7 %	4,7 %
91-180	6,3 %	5,7 %
>180	6,4 %	6,4 %
<b>Total</b>	<b>4,0 %</b>	<b>3,6 %</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	6 al 10 de Septiembre				13 al 17 de Septiembre				20 al 24 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	65	131	663	450	32	180	493	256	9	102	421	343
<b>Real</b>	86	20	80	293	169	21	67	304	100	7	35	113
<b>Total</b>	151	151	743	743	201	201	560	560	109	109	456	456

\* 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 8 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.