

Fecha de publicación: 17 de Septiembre de 2004  
 Fecha de Información: 15 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\$201,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	68,5	75,5	33,6	26,6	102,1
15-35	51,3	40,8	11,3	21,8	62,5
36-60	18,0	10,0	-	8,0	18,0
61-90	11,0	9,2	0,2	2,0	11,2
91-180	-	2,8	2,8	-	2,8
>180	4,0	0,7	0,7	4,0	4,7
<b>Total</b>	<b>152,8</b>	<b>139,0</b>	<b>48,6</b>	<b>62,4</b>	<b>201,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,2 %	3,4 %
15-35	13,8 %	17,1 %
36-60	3,1 %	3,4 %
61-90	4,3 %	4,8 %
91-180	6,0 %	5,7 %
>180	6,5 %	6,3 %
<b>Total</b>	<b>6,7 %</b>	<b>7,8 %</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	13 al 17 de Septiembre				20 al 24 de Septiembre				27 de Sep. al 1 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	44	247	707	378	21	122	571	457	6	174	458	401
<b>Real</b>	233	31	74	403	119	19	72	186	173	5	203	260
<b>Total</b>	277	277	782	782	141	141	644	644	179	179	661	661

\* 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 16 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.