

Fecha de publicación: 30 de Septiembre de 2004  
 Fecha de Información: 28 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\$219,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	104,9	119,3	19,3	4,9	124,2
15-35	63,8	41,0	9,0	31,8	72,8
36-60	-	4,3	4,3	-	4,3
61-90	7,4	8,6	2,6	1,4	10,1
91-180	-	0,2	0,2	-	0,2
>180	4,1	6,7	3,7	1,1	7,8
<b>Total</b>	<b>180,2</b>	<b>180,3</b>	<b>39,3</b>	<b>39,2</b>	<b>219,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,0 %	2,8 %
15-35	2,4 %	2,2 %
36-60	4,2 %	3,9 %
61-90	4,4 %	4,7 %
91-180	5,5 %	5,5 %
>180	5,9 %	6,0 %
<b>Total</b>	<b>3,3 %</b>	<b>2,8 %</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**

Sector	27 de Sep. al 1 de Octubre				4 al 8 de Octubre				11 al 15 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	28	199	733	665	19	101	643	572	22	202	495	416
<b>Real</b>	193	22	262	329	93	11	210	281	196	16	154	233
<b>Total</b>	221	221	995	995	112	112	853	853	218	218	650	650

\* 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 29 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.