

Fecha de publicación: 4 de Octubre de 2004  
 Fecha de Información: 30 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\$211,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,1	13,3	10,8	35,6	48,9
15-35	69,7	114,1	66,1	21,7	135,8
36-60	22,0	20,6	0,6	2,0	22,6
61-90	2,1	-	-	2,1	2,1
91-180	-	1,0	1,0	-	1,0
>180	-	1,2	1,2	-	1,2
<b>Total</b>	<b>131,9</b>	<b>150,2</b>	<b>79,7</b>	<b>61,4</b>	<b>211,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,8 %	-11,6 %
15-35	1,6 %	4,4 %
36-60	3,2 %	4,3 %
61-90	5,0 %	5,3 %
91-180	6,2 %	6,2 %
>180	6,3 %	6,3 %
<b>Total</b>	<b>2,1 %</b>	<b>0,7 %</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	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	22	111	718	635	28	226	503	433
<b>Real</b>	193	22	262	329	104	14	232	315	220	22	166	236
<b>Total</b>	221	221	995	995	126	126	950	950	248	248	669	669

\* 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 1 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.