

Fecha de publicación: 29 de Septiembre de 2004  
 Fecha de Información: 27 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\$181,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -6,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	50,5	31,8	1,3	20,0	51,7
15-35	57,0	52,6	14,6	19,0	71,6
36-60	7,6	18,8	11,3	0,1	18,9
61-90	16,2	18,5	2,5	0,2	18,7
91-180	6,0	6,1	0,1	-	6,1
>180	3,0	14,7	11,7	-	14,7
<b>Total</b>	<b>140,3</b>	<b>142,4</b>	<b>41,4</b>	<b>39,3</b>	<b>181,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-15,1 %	-29,4 %
15-35	1,4 %	2,1 %
36-60	1,9 %	1,5 %
61-90	4,4 %	5,1 %
91-180	4,9 %	5,8 %
>180	5,5 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>-2,1 %</b>	<b>-6,3 %</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	715	647	19	101	592	524	21	197	447	363
<b>Real</b>	193	22	262	329	93	11	209	277	191	15	141	225
<b>Total</b>	221	221	976	976	112	112	801	801	212	212	589	589

\* 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 28 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.