

Fecha de publicación: 6 de Octubre de 2004  
 Fecha de Información: 4 de Octubre 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\$293,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,6	52,6	7,6	0,6	53,2
15-35	151,7	126,6	55,9	81,0	207,7
36-60	0,7	1,2	1,2	0,7	1,9
61-90	-	1,8	1,8	-	1,8
91-180	0,0	3,6	3,5	-	3,6
>180	25,0	5,1	0,1	20,0	25,1
<b>Total</b>	<b>223,1</b>	<b>190,9</b>	<b>70,2</b>	<b>102,3</b>	<b>293,3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,7 %	7,6 %
15-35	3,2 %	3,1 %
36-60	5,6 %	5,4 %
61-90	5,1 %	6,0 %
91-180	6,3 %	5,5 %
>180	6,0 %	5,8 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>4,2 %</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	4 al 8 de Octubre				11 al 15 de Octubre				18 al 22 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	24	115	761	680	34	226	578	573	8	85	446	417
<b>Real</b>	108	17	234	315	220	28	237	241	84	7	132	161
<b>Total</b>	132	132	995	995	254	254	815	815	93	93	578	578

\* 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 5 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.