

Fecha de publicación: 12 de Octubre de 2004  
 Fecha de Información: 8 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\$282,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	36,6	43,8	17,8	10,6	54,4
15-35	68,6	49,9	18,7	37,4	87,3
36-60	1,2	13,6	12,4	-	13,6
61-90	23,0	5,9	2,9	20,0	25,9
91-180	95,0	13,9	2,7	83,9	97,7
>180	-	3,6	3,6	-	3,6
<b>Total</b>	<b>224,5</b>	<b>130,6</b>	<b>58,1</b>	<b>151,9</b>	<b>282,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	11,8 %	18,0 %
15-35	4,6 %	4,4 %
36-60	3,5 %	5,8 %
61-90	2,9 %	4,3 %
91-180	4,9 %	3,9 %
>180	6,1 %	6,1 %
<b>Total</b>	<b>6,1 %</b>	<b>6,9 %</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>	25	121	776	680	56	246	650	662	10	96	553	523
<b>Real</b>	113	17	234	330	237	47	265	254	95	9	138	168
<b>Total</b>	137	137	1010	1010	293	293	916	916	105	105	691	691

\* 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 11 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.