

Fecha de publicación: 13 de Octubre de 2004  
 Fecha de Información: 11 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\$198,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	67,9	54,8	2,7	15,8	70,6
15-35	65,5	103,5	44,5	6,5	110,0
36-60	0,1	3,2	3,2	-	3,2
61-90	-	0,3	0,3	-	0,3
91-180	10,6	12,6	2,0	-	12,6
>180	-	2,2	2,2	-	2,2
<b>Total</b>	<b>144,1</b>	<b>176,6</b>	<b>54,8</b>	<b>22,3</b>	<b>198,9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-3,8 %	-3,9 %
15-35	2,7 %	2,2 %
36-60	4,0 %	4,7 %
61-90	3,8 %	4,0 %
91-180	6,2 %	4,5 %
>180	5,9 %	2,4 %
<b>Total</b>	<b>2,4 %</b>	<b>0,3 %</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	11 al 15 de Octubre				18 al 22 de Octubre				25 al 29 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	56	246	698	710	10	97	572	527	9	87	506	518
<b>Real</b>	237	47	266	254	96	9	138	183	81	3	221	209
<b>Total</b>	293	293	964	964	105	105	711	711	90	90	728	728

\* 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 12 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.