

Fecha de publicación: 15 de Octubre de 2004  
 Fecha de Información: 13 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\$381,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	110,1	99,4	25,4	36,1	135,5
15-35	82,0	137,2	63,2	8,0	145,2
36-60	0,1	12,0	11,9	-	12,0
61-90	23,1	18,8	5,8	10,0	28,8
91-180	20,2	38,5	33,3	15,0	53,5
>180	-	6,6	6,6	-	6,6
<b>Total</b>	<b>235,4</b>	<b>312,5</b>	<b>146,2</b>	<b>69,1</b>	<b>381,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,5 %	-2,4 %
15-35	4,3 %	6,0 %
36-60	4,7 %	5,3 %
61-90	4,5 %	4,5 %
91-180	5,5 %	3,0 %
>180	3,6 %	1,3 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>2,4 %</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	236	713	735	23	129	703	619	10	142	563	577
<b>Real</b>	226	47	276	254	118	12	146	231	136	4	232	218
<b>Total</b>	283	283	989	989	141	141	849	849	146	146	795	795

\* 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 14 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.