

Fecha de publicación: 22 de Octubre de 2004  
 Fecha de Información: 20 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\$227,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	65,2	58,0	2,0	9,2	67,2
15-35	79,6	132,0	64,5	12,1	144,1
36-60	2,0	2,9	0,9	-	2,9
61-90	-	6,7	6,7	-	6,7
91-180	-	0,3	0,3	-	0,3
>180	6,3	2,0	-	4,3	6,3
<b>Total</b>	<b>153,0</b>	<b>201,9</b>	<b>74,4</b>	<b>25,5</b>	<b>227,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,1 %	1,4 %
15-35	2,6 %	3,3 %
36-60	5,1 %	5,4 %
61-90	4,5 %	3,8 %
91-180	5,2 %	5,2 %
>180	6,1 %	6,2 %
<b>Total</b>	<b>2,5 %</b>	<b>2,9 %</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	18 al 22 de Octubre				25 al 29 de Octubre				1 al 5 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	56	161	829	749	36	181	711	781	14	78	721	599
<b>Real</b>	120	15	197	277	160	15	310	240	66	2	176	297
<b>Total</b>	176	176	1026	1026	195	195	1021	1021	80	80	897	897

\* 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 21 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.