

Fecha de publicación: 28 de Octubre de 2004  
 Fecha de Información: 26 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\$173,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,9	22,5	2,0	18,4	40,9
15-35	80,6	54,3	14,7	41,0	95,3
36-60	15,5	0,0	0,0	15,5	15,5
61-90	2,0	3,4	1,4	-	3,4
91-180	2,1	4,1	4,1	2,1	6,2
>180	3,0	11,8	8,8	-	11,8
<b>Total</b>	<b>142,1</b>	<b>96,1</b>	<b>31,0</b>	<b>77,0</b>	<b>173,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-3,3 %	-7,3 %
15-35	3,9 %	5,0 %
36-60	4,8 %	4,0 %
61-90	5,2 %	5,6 %
91-180	5,6 %	5,2 %
>180	6,0 %	5,7 %
<b>Total</b>	<b>2,5 %</b>	<b>2,1 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

**Vencimientos de Forwards**

Sectores	25 al 29 de Octubre				1 al 5 de Noviembre				8 al 12 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	43	188	884	917	25	81	802	658	9	120	524	522
<b>Real</b>	166	21	331	298	69	13	195	338	119	7	147	148
<b>Total</b>	209	209	1215	1215	94	94	997	997	128	128	670	670

\* 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 27 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.