

Fecha de publicación: 3 de Noviembre de 2004  
 Fecha de Información: 29 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\$282,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,8	37,9	15,0	22,9	60,8
15-35	32,9	147,0	124,5	10,4	157,4
36-60	10,0	32,5	22,5	0,0	32,5
61-90	-	2,2	2,2	-	2,2
91-180	22,1	25,8	3,7	-	25,8
>180	-	4,1	4,1	-	4,1
<b>Total</b>	<b>110,7</b>	<b>249,6</b>	<b>172,1</b>	<b>33,2</b>	<b>282,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,4 %	-6,1 %
15-35	4,2 %	4,3 %
36-60	5,2 %	4,7 %
61-90	5,9 %	5,0 %
91-180	6,0 %	5,6 %
>180	6,3 %	5,7 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>2,2 %</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	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	49	111	912	739	13	126	565	570
<b>Real</b>	166	21	331	298	80	18	207	380	124	11	175	170
<b>Total</b>	209	209	1215	1215	129	129	1119	1119	137	137	740	740

\* 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 2 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.