

Fecha de publicación: 2 de Diciembre de 2004  
 Fecha de Información: 30 de Noviembre 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\$166,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	22,6	49,6	34,0	7,1	56,6
15-35	45,1	43,9	26,9	28,1	72,0
36-60	11,0	16,5	6,5	1,0	17,5
61-90	12,0	6,2	1,2	7,0	13,2
91-180	0,1	3,9	3,9	0,1	4,0
>180	3,6	1,0	-	2,6	3,6
<b>Total</b>	<b>94,5</b>	<b>120,9</b>	<b>72,4</b>	<b>45,9</b>	<b>166,9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,5 %	10,7 %
15-35	3,1 %	2,5 %
36-60	3,9 %	3,0 %
61-90	4,2 %	4,1 %
91-180	5,6 %	4,7 %
>180	4,0 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>4,7 %</b>	<b>5,6 %</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	29 de Nov. al 3 de Diciembre				6 al 10 de Diciembre				13 al 17 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	95	165	584	519	11	68	712	544	24	96	503	487
<b>Real</b>	133	64	97	162	64	7	127	295	89	17	211	227
<b>Total</b>	228	228	681	681	75	75	839	839	113	113	714	714

\* 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 1 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.