

**Fecha de publicación: 6 de Diciembre de 2004**  
**Fecha de Información: 2 de Diciembre 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\$420,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	77,1	52,0	6,0	31,1	83,1
15-35	82,7	143,1	82,7	22,3	165,4
36-60	12,4	16,0	12,7	9,1	25,1
61-90	28,6	108,5	101,5	21,6	130,0
91-180	2,3	11,1	11,1	2,3	13,4
>180	3,0	-	-	3,0	3,0
<b>Total</b>	<b>206,1</b>	<b>330,8</b>	<b>213,9</b>	<b>89,3</b>	<b>420,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,5 %	2,6 %
15-35	2,9 %	3,7 %
36-60	3,1 %	2,7 %
61-90	3,9 %	4,4 %
91-180	4,8 %	5,5 %
>180	4,7 %	4,7 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,7 %</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	27	72	730	576	28	96	570	543
<b>Real</b>	133	64	97	162	64	20	151	305	89	21	227	255
<b>Total</b>	228	228	681	681	92	92	881	881	117	117	797	797

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) ^ (365/\text{Plazo})) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 3 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.