

Fecha de publicación: 10 de Diciembre de 2004  
 Fecha de Información: 7 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\$333,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	54,1	89,0	52,0	17,1	106,1
15-35	68,8	121,3	79,1	26,6	147,9
36-60	5,0	7,2	2,2	-	7,2
61-90	55,5	7,9	0,9	48,5	56,4
91-180	10,4	2,5	2,5	10,4	12,9
>180	1,0	2,6	1,6	-	2,6
<b>Total</b>	<b>194,8</b>	<b>230,5</b>	<b>138,3</b>	<b>102,6</b>	<b>333,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,1 %	7,3 %
15-35	5,2 %	6,4 %
36-60	4,2 %	2,9 %
61-90	3,8 %	3,5 %
91-180	5,9 %	5,0 %
>180	6,1 %	6,0 %
<b>Total</b>	<b>4,9 %</b>	<b>6,1 %</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	6 al 10 de Diciembre				13 al 17 de Diciembre				20 al 24 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	28	72	732	583	33	98	687	686	19	86	341	311
<b>Real</b>	64	20	158	307	91	26	276	277	77	10	105	135
<b>Total</b>	92	92	890	890	124	124	962	962	96	96	446	446

\* 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 8 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.