

Fecha de publicación: 5 de Noviembre de 2004  
 Fecha de Información: 3 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\$293,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	71,9	32,9	13,4	52,4	85,3
15-35	97,0	62,4	17,4	52,0	114,4
36-60	0,0	2,2	2,2	-	2,2
61-90	23,1	57,0	46,9	13,0	70,0
91-180	2,0	2,7	0,7	-	2,7
>180	10,0	8,8	8,8	10,0	18,8
<b>Total</b>	<b>204,0</b>	<b>165,9</b>	<b>89,3</b>	<b>127,4</b>	<b>293,3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,6 %	3,6 %
15-35	7,8 %	4,6 %
36-60	5,4 %	4,7 %
61-90	4,9 %	4,7 %
91-180	5,7 %	5,4 %
>180	5,8 %	5,7 %
<b>Total</b>	<b>6,2 %</b>	<b>4,4 %</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	1 al 5 de Noviembre				8 al 12 de Noviembre				15 al 19 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	49	111	919	747	14	128	617	588	35	103	530	498
<b>Real</b>	80	18	208	380	126	12	188	216	98	29	94	126
<b>Total</b>	129	129	1127	1127	140	140	805	805	132	132	624	624

\* 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 4 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.