

Fecha de publicación: 8 de Noviembre de 2004  
 Fecha de Información: 4 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\$335,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	79,3	100,9	49,7	28,1	129,0
15-35	103,1	79,1	27,1	51,1	130,2
36-60	8,0	13,2	5,1	-	13,2
61-90	2,0	31,4	31,4	2,0	33,4
91-180	17,5	6,2	3,7	15,0	21,2
>180	7,0	1,3	1,3	7,0	8,3
<b>Total</b>	<b>216,9</b>	<b>232,1</b>	<b>118,3</b>	<b>103,1</b>	<b>335,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,6 %	6,8 %
15-35	5,2 %	7,0 %
36-60	4,5 %	5,0 %
61-90	5,0 %	4,8 %
91-180	5,7 %	3,9 %
>180	6,0 %	6,3 %
<b>Total</b>	<b>5,0 %</b>	<b>6,4 %</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**

Sector	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	15	158	684	646	35	104	554	522
<b>Real</b>	80	18	208	380	156	13	204	243	99	29	97	129
<b>Total</b>	129	129	1127	1127	171	171	888	888	134	134	651	651

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

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

<sup>3</sup> A partir del 5 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.