

Fecha de publicación: 9 de Noviembre de 2004  
 Fecha de Información: 5 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\$428,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	136,9	73,0	21,5	85,4	158,4
15-35	104,9	55,9	17,9	66,9	122,8
36-60	30,7	17,3	0,2	13,6	30,9
61-90	31,0	99,5	78,5	10,0	109,5
91-180	0,1	0,4	0,3	-	0,4
>180	-	6,4	6,4	-	6,4
<b>Total</b>	<b>303,5</b>	<b>252,6</b>	<b>124,9</b>	<b>175,8</b>	<b>428,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	9,2 %	-1,4 %
15-35	5,4 %	5,0 %
36-60	4,8 %	6,6 %
61-90	4,1 %	4,0 %
91-180	5,8 %	5,7 %
>180	6,0 %	5,4 %
<b>Total</b>	<b>6,6 %</b>	<b>2,5 %</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	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	66	176	730	668	43	109	587	550
<b>Real</b>	80	18	208	380	174	64	204	266	101	34	98	135
<b>Total</b>	129	129	1127	1127	240	240	934	934	143	143	685	685

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