

Fecha de publicación: 11 de Noviembre de 2004  
 Fecha de Información: 9 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\$141,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	34,8	30,2	9,2	13,8	44,0
15-35	48,5	31,8	10,1	26,7	58,5
36-60	16,4	5,1	0,1	11,4	16,5
61-90	10,1	10,6	0,5	-	10,6
91-180	-	1,2	1,2	-	1,2
>180	10,0	10,9	0,9	-	10,9
<b>Total</b>	<b>119,8</b>	<b>89,8</b>	<b>21,9</b>	<b>51,9</b>	<b>141,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,7 %	9,2 %
15-35	5,3 %	5,2 %
36-60	5,7 %	5,8 %
61-90	5,8 %	5,5 %
91-180	6,3 %	6,2 %
>180	6,9 %	5,5 %
<b>Total</b>	<b>5,9 %</b>	<b>6,6 %</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	8 al 12 de Noviembre				15 al 19 de Noviembre				22 al 26 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	66	177	777	686	51	109	633	601	11	139	305	311
<b>Real</b>	175	64	210	301	101	42	104	137	137	8	112	105
<b>Total</b>	241	241	987	987	152	152	737	737	147	147	416	416

\* 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 10 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.