

Fecha de publicación: 12 de Noviembre de 2004  
 Fecha de Información: 10 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\$230,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	49,9	48,3	19,8	21,4	69,6
15-35	94,3	86,1	18,3	26,5	112,6
36-60	28,1	16,2	0,2	12,1	28,3
61-90	6,2	2,3	0,3	4,2	6,5
91-180	5,8	1,1	0,8	5,6	6,6
>180	6,0	5,5	0,5	1,0	6,5
<b>Total</b>	<b>190,2</b>	<b>159,4</b>	<b>39,9</b>	<b>70,7</b>	<b>230,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,0 %	3,3 %
15-35	5,6 %	5,4 %
36-60	5,2 %	4,5 %
61-90	4,6 %	5,7 %
91-180	5,7 %	5,6 %
>180	5,9 %	6,1 %
<b>Total</b>	<b>6,0 %</b>	<b>4,7 %</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	57	109	670	645	12	139	317	317
<b>Real</b>	175	64	210	301	101	49	122	147	137	10	116	115
<b>Total</b>	241	241	987	987	158	158	792	792	149	149	432	432

\* 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 11 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.