

Fecha de publicación: 18 de Noviembre de 2004  
 Fecha de Información: 16 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\$243,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	65,4	70,3	7,3	2,4	72,7
15-35	69,0	127,0	75,0	17,0	144,0
36-60	0,2	0,1	0,1	0,2	0,3
61-90	24,0	8,3	0,3	16,0	24,3
91-180	-	0,0	0,0	-	0,0
>180	2,0	0,2	0,2	2,0	2,2
<b>Total</b>	<b>160,6</b>	<b>205,8</b>	<b>82,8</b>	<b>37,6</b>	<b>243,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,6 %	3,1 %
15-35	4,1 %	4,4 %
36-60	4,7 %	3,9 %
61-90	4,8 %	4,5 %
91-180	5,4 %	5,4 %
>180	5,6 %	5,3 %
<b>Total</b>	<b>4,1 %</b>	<b>4,0 %</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	15 al 19 de Noviembre				22 al 26 de Noviembre				29 de Nov. al 3 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	59	110	756	705	15	149	377	378	14	138	348	314
<b>Real</b>	101	50	128	179	147	12	124	124	127	4	75	108
<b>Total</b>	160	160	884	884	161	161	501	501	141	141	423	423

\* 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 17 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.