

Fecha de publicación: 26 de Noviembre de 2004  
 Fecha de Información: 24 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\$285,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	96,2	59,3	8,3	45,2	104,5
15-35	67,7	76,5	26,7	18,0	94,5
36-60	12,1	13,0	7,9	7,0	20,0
61-90	47,0	60,0	17,0	4,0	64,0
91-180	-	1,4	1,4	-	1,4
>180	-	1,2	1,2	-	1,2
<b>Total</b>	<b>223,1</b>	<b>211,3</b>	<b>62,4</b>	<b>74,2</b>	<b>285,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,7 %	4,4 %
15-35	3,8 %	3,9 %
36-60	4,7 %	3,9 %
61-90	4,6 %	4,3 %
91-180	6,2 %	5,4 %
>180	5,7 %	5,7 %
<b>Total</b>	<b>3,6 %</b>	<b>4,2 %</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	22 al 26 de Noviembre				29 de Nov. al 3 de Dic.				6 al 10 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	51	167	506	476	86	164	550	491	9	56	602	437
<b>Real</b>	157	40	129	159	133	56	91	149	52	5	110	275
<b>Total</b>	207	207	635	635	220	220	640	640	61	61	712	712

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

<sup>3</sup> A partir del 25 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.