

Fecha de publicación: 12 de Noviembre de 2003  
 Fecha de Información: 10 de Noviembre de 2003 <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\$226.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	40.9	35.1	2.9	8.7	43.8
15 a 35	106.8	117.6	45.0	34.2	151.7
36 a 60	10.2	8.4	6.4	8.2	16.6
61 a 90	2.0	5.3	3.3	-	5.3
91 a 180	-	4.3	4.3	-	4.3
>180	-	4.4	4.4	-	4.4
<b>Total</b>	<b>159.8</b>	<b>175.0</b>	<b>66.2</b>	<b>51.0</b>	<b>226.0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	7.9 %	8.1 %
15 a 35	9.2 %	9.5 %
36 a 60	9.5 %	9.3 %
61 a 90	9.7 %	9.6 %
91 a 180	9.4 %	9.4 %
>180	9.3 %	9.1 %
<b>Total</b>	<b>9.0 %</b>	<b>9.2 %</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	10 al 14 de Noviembre				17 al 21 de Noviembre				24 al 28 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	63	67	417	309	20	21	276	155	3	14	241	245
<b>Real</b>	45	42	121	229	18	16	71	192	14	3	115	111
<b>Total</b>	108	108	538	538	37	37	347	347	17	17	356	356

\* 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) ^ (Plazo/365)) - 1

<sup>3</sup> A partir del 11 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.