

Fecha de publicación: 21 de Noviembre de 2003  
 Fecha de Información: 19 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\$79.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	3.4	6.9	5.4	1.9	8.8
15 a 35	44.5	29.3	1.3	16.5	45.8
36 a 60	6.0	6.4	1.4	1.0	7.4
61 a 90	1.0	7.3	6.3	-	7.3
91 a 180	1.3	6.7	6.5	1.1	7.8
>180	-	2.6	2.6	-	2.6
<b>Total</b>	<b>56.1</b>	<b>59.1</b>	<b>23.4</b>	<b>20.4</b>	<b>79.6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.7 %	9.9 %
15 a 35	9.3 %	9.2 %
36 a 60	9.5 %	9.9 %
61 a 90	9.3 %	9.5 %
91 a 180	9.6 %	9.6 %
>180	9.6 %	9.5 %
<b>Total</b>	<b>9.5 %</b>	<b>9.4 %</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	17 al 21 de Noviembre				24 al 28 de Noviembre				1 al 5 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	33	22	300	169	7	16	332	297	50	13	347	290
<b>Real</b>	19	30	79	211	15	7	134	169	13	50	87	144
<b>Total</b>	52	52	380	380	22	22	466	466	63	63	434	434

\* 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 20 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.