

Fecha de publicación: 24 de Noviembre de 2003  
 Fecha de Información: 20 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\$158.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	80.0	34.4	6.0	51.6	86.0
15 a 35	46.0	28.2	0.2	18.0	46.2
36 a 60	12.0	13.8	1.8	-	13.8
61 a 90	1.1	3.1	2.1	-	3.1
91 a 180	3.1	7.0	6.0	2.1	9.1
>180	-	0.2	0.2	-	0.2
<b>Total</b>	<b>142.1</b>	<b>86.7</b>	<b>16.2</b>	<b>71.7</b>	<b>158.3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	13.5 %	5.9 %
15 a 35	8.3 %	8.1 %
36 a 60	9.6 %	8.8 %
61 a 90	9.2 %	8.6 %
91 a 180	9.1 %	9.1 %
>180	9.1 %	9.1 %
<b>Total</b>	<b>10.8 %</b>	<b>7.1 %</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	13	20	388	326	56	13	360	293
<b>Real</b>	19	30	79	211	16	10	139	201	13	56	87	154
<b>Total</b>	52	52	380	380	29	29	527	527	69	69	447	447

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (\text{Plazo}/365)) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 21 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.