

Fecha de publicación: 26 de Noviembre de 2003  
 Fecha de Información: 24 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\$105.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	18.4	3.1	1.6	16.9	20.0
15 a 35	63.8	44.5	0.0	19.3	63.8
36 a 60	21.0	0.1	0.1	21.0	21.1
61 a 90	-	0.3	0.3	-	0.3
91 a 180	-	0.6	0.6	-	0.6
>180	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>103.2</b>	<b>48.6</b>	<b>2.6</b>	<b>57.2</b>	<b>105.8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	7.3 %	7.5 %
15 a 35	9.3 %	9.0 %
36 a 60	13.1 %	10.0 %
61 a 90	10.1 %	10.1 %
91 a 180	10.0 %	9.7 %
>180	-	-
<b>Total</b>	<b>9.3 %</b>	<b>8.9 %</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	24 al 28 de Noviembre				1 al 5 de Diciembre				8 al 12 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	17	21	392	330	62	14	389	303	8	27	370	259
<b>Real</b>	16	12	143	205	14	62	87	172	27	7	86	197
<b>Total</b>	33	33	535	535	76	76	476	476	35	35	456	456

\* 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 25 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.