

Fecha de publicación: 2 de Diciembre de 2003  
 Fecha de Información: 28 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\$71.9 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	24.6	17.1	3.1	10.6	27.7
15 a 35	18.1	15.7	0.0	2.5	18.2
36 a 60	11.5	7.0	0.0	4.5	11.5
61 a 90	1.8	3.1	3.1	1.8	4.9
91 a 180	7.0	7.5	0.5	-	7.5
>180	1.5	0.6	0.6	1.5	2.1
<b>Total</b>	<b>64.6</b>	<b>51.0</b>	<b>7.3</b>	<b>20.9</b>	<b>71.9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	6.4 %	7.4 %
15 a 35	9.8 %	10.6 %
36 a 60	9.9 %	10.4 %
61 a 90	9.6 %	9.5 %
91 a 180	9.6 %	9.7 %
>180	7.2 %	2.8 %
<b>Total</b>	<b>8.5 %</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>	19	21	415	353	56	16	465	356	10	28	404	285
<b>Real</b>	16	14	162	224	15	56	107	216	28	10	92	211
<b>Total</b>	35	35	577	577	71	71	572	572	38	38	497	497

\* 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 1 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.