

Fecha de publicación: 10 de Noviembre de 2003  
 Fecha de Información: 6 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\$199.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	13.1	25.4	15.0	2.7	28.1
15 a 35	87.7	142.7	73.5	18.6	161.2
36 a 60	0.9	1.3	0.4	-	1.3
61 a 90	0.1	0.7	0.6	-	0.7
91 a 180	0.5	1.6	1.6	0.5	2.1
>180	6.4	-	-	6.4	6.4
<b>Total</b>	<b>108.7</b>	<b>171.6</b>	<b>91.1</b>	<b>28.2</b>	<b>199.8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.5 %	12.2 %
15 a 35	9.7 %	10.6 %
36 a 60	9.2 %	9.1 %
61 a 90	9.6 %	9.7 %
91 a 180	9.8 %	9.9 %
>180	9.3 %	9.3 %
<b>Total</b>	<b>9.4 %</b>	<b>10.7 %</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**

Sector	3 al 7 de Noviembre				10 al 14 de Noviembre				17 al 21 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	43	17	354	310	57	65	383	286	11	20	237	141
<b>Real</b>	15	41	105	149	45	36	118	214	18	8	69	164
<b>Total</b>	58	58	459	459	101	101	501	501	28	28	306	306

\* 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 7 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.