

Fecha de publicación: 5 de Septiembre de 2003  
 Fecha de Información: 3 de Septiembre 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\$172.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	42.5	37.5	7.5	12.5	49.9
15 a 35	66.5	30.9	2.9	38.5	69.4
36 a 60	9.0	1.9	1.9	9.0	10.9
61 a 90	6.6	7.2	4.1	3.5	10.7
91 a 180	0.1	21.5	21.3	-	21.5
>180	-	10.0	10.0	-	10.0
<b>Total</b>	<b>124.7</b>	<b>109.0</b>	<b>47.8</b>	<b>63.5</b>	<b>172.5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	11.3 %	15.6 %
15 a 35	9.1 %	8.2 %
36 a 60	8.7 %	6.6 %
61 a 90	9.0 %	9.0 %
91 a 180	9.1 %	8.5 %
>180	9.0 %	8.9 %
<b>Total</b>	<b>9.3 %</b>	<b>10.4 %</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**

Sector	1 al 5 de Septiembre				8 al 12 de Septiembre				15 al 19 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	106	66	364	189	14	26	323	158	22	25	242	160
<b>Real</b>	16	57	39	213	25	13	53	218	19	16	34	116
<b>Total</b>	122	122	403	403	39	39	376	376	41	41	275	275

\* 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 4 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.