

Fecha de publicación: 23 de Septiembre de 2003  
 Fecha de Información: 19 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\$89.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	38.5	29.9	7.8	16.3	46.2
15 a 35	33.0	25.2	1.0	8.8	34.0
36 a 60	0.2	0.1	0.1	0.2	0.3
61 a 90	8.0	5.3	0.3	3.0	8.3
91 a 180	-	0.2	0.2	-	0.2
>180	-	0.0	0.0	-	0.0
<b>Total</b>	<b>79.7</b>	<b>60.7</b>	<b>9.4</b>	<b>28.3</b>	<b>89.0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.0 %	6.3 %
15 a 35	9.7 %	9.5 %
36 a 60	9.3 %	8.8 %
61 a 90	9.6 %	9.1 %
91 a 180	9.7 %	9.7 %
>180	10.3 %	10.3 %
<b>Total</b>	<b>9.2 %</b>	<b>7.8 %</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	15 al 19 de Septiembre				22 al 26 de Septiembre				29 de Sep. al 3 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	29	26	384	253	42	46	445	230	70	31	375	253
<b>Real</b>	21	24	67	198	29	26	56	272	17	56	86	208
<b>Total</b>	50	50	451	451	71	71	502	502	87	87	461	461

\* 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 22 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.