

Fecha de publicación: 24 de Septiembre de 2003  
 Fecha de Información: 22 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\$38.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	6.3	12.3	12.3	6.3	18.6
15 a 35	15.6	4.0	-	11.6	15.6
36 a 60	1.9	1.0	-	0.9	1.9
61 a 90	0.2	0.0	0.0	0.2	0.2
91 a 180	2.0	2.1	0.1	-	2.1
>180	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>25.9</b>	<b>19.4</b>	<b>12.4</b>	<b>18.9</b>	<b>38.4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	2.2 %	7.5 %
15 a 35	10.9 %	9.6 %
36 a 60	9.1 %	8.0 %
61 a 90	10.1 %	8.7 %
91 a 180	9.1 %	9.4 %
>180	-	-
<b>Total</b>	<b>5.9 %</b>	<b>8.5 %</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	22 al 26 de Septiembre				29 de Sep. al 3 de Octubre				6 al 10 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	45	46	445	240	72	31	375	255	36	48	246	265
<b>Real</b>	29	29	66	272	18	59	88	208	43	31	137	118
<b>Total</b>	74	74	512	512	90	90	463	463	79	79	383	383

\* 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 23 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.