

Fecha de publicación: 2 de Octubre de 2003  
 Fecha de Información: 30 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\$87.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	31.1	35.2	20.5	16.4	51.6
15 a 35	19.9	11.1	0.8	9.6	20.7
36 a 60	0.7	0.2	0.2	0.7	0.8
61 a 90	-	2.5	2.5	-	2.5
91 a 180	-	3.8	3.8	-	3.8
>180	0.2	7.6	7.6	0.2	7.8
<b>Total</b>	<b>51.9</b>	<b>60.4</b>	<b>35.4</b>	<b>26.9</b>	<b>87.3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	11.7 %	7.5 %
15 a 35	9.6 %	7.7 %
36 a 60	10.0 %	10.2 %
61 a 90	9.4 %	9.6 %
91 a 180	9.8 %	9.8 %
>180	9.5 %	9.5 %
<b>Total</b>	<b>10.7 %</b>	<b>7.9 %</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	29 de Sep. al 3 de Octubre				6 al 10 de Octubre				13 al 17 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	102	35	436	306	43	66	381	341	16	23	219	131
<b>Real</b>	18	86	103	233	61	37	151	191	16	10	39	127
<b>Total</b>	121	121	539	539	104	104	533	533	33	33	258	258

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