

Fecha de publicación: 3 de Octubre de 2003  
 Fecha de Información: 1 de Octubre 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\$133.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4.8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	24.2	65.2	45.2	4.2	69.5
15 a 35	50.1	29.5	4.5	25.1	54.6
36 a 60	-	0.1	0.1	-	0.1
61 a 90	7.4	2.1	0.1	5.4	7.5
91 a 180	0.5	0.0	0.0	0.5	0.5
>180	1.2	0.0	0.0	1.2	1.2
<b>Total</b>	<b>83.3</b>	<b>97.0</b>	<b>50.0</b>	<b>36.3</b>	<b>133.3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	7.5 %	0.3 %
15 a 35	10.1 %	10.0 %
36 a 60	11.2 %	10.7 %
61 a 90	8.7 %	8.1 %
91 a 180	9.4 %	8.1 %
>180	9.6 %	8.8 %
<b>Total</b>	<b>8.9 %</b>	<b>4.8 %</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	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	46	97	402	361	17	23	251	160
<b>Real</b>	18	86	103	233	92	40	151	192	16	11	53	144
<b>Total</b>	121	121	539	539	138	138	554	554	33	33	304	304

\* 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 2 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.