

Fecha de publicación: 6 de Octubre de 2003  
 Fecha de Información: 2 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\$155.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	30.3	52.1	28.1	6.3	58.4
15 a 35	68.9	39.1	3.1	32.9	71.9
36 a 60	11.2	13.5	2.5	0.2	13.7
61 a 90	-	0.1	0.1	-	0.1
91 a 180	1.0	6.1	5.1	-	6.1
>180	5.0	0.0	0.0	5.0	5.0
<b>Total</b>	<b>116.4</b>	<b>110.8</b>	<b>38.8</b>	<b>44.4</b>	<b>155.2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	7.3 %	6.3 %
15 a 35	9.7 %	9.4 %
36 a 60	9.1 %	9.3 %
61 a 90	9.7 %	9.7 %
91 a 180	10.0 %	9.7 %
>180	9.5 %	9.1 %
<b>Total</b>	<b>8.9 %</b>	<b>8.3 %</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	59	129	400	359	18	23	279	182
<b>Real</b>	18	86	103	233	116	46	151	192	17	12	57	154
<b>Total</b>	121	121	539	539	175	175	552	552	34	34	336	336

\* 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 3 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.