

Fecha de publicación: 9 de Octubre de 2003  
 Fecha de Información: 7 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\$156.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 15.5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	55.2	57.0	26.5	24.7	81.7
15 a 35	43.8	25.2	1.4	20.0	45.2
36 a 60	8.1	5.6	0.6	3.1	8.7
61 a 90	1.8	1.4	1.4	1.8	3.2
91 a 180	-	11.5	11.5	-	11.5
>180	-	6.0	6.0	-	6.0
<b>Total</b>	<b>108.9</b>	<b>106.6</b>	<b>47.3</b>	<b>49.6</b>	<b>156.2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	17.2 %	20.5 %
15 a 35	9.2 %	10.0 %
36 a 60	10.4 %	12.1 %
61 a 90	10.2 %	10.9 %
91 a 180	9.0 %	8.6 %
>180	9.3 %	9.1 %
<b>Total</b>	<b>12.5 %</b>	<b>15.5 %</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	6 al 10 de Octubre				13 al 17 de Octubre				20 al 24 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	76	154	464	402	21	48	355	237	29	39	317	243
<b>Real</b>	141	63	159	220	41	14	61	178	31	21	117	192
<b>Total</b>	216	216	623	623	62	62	416	416	60	60	434	434

\* 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 8 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.