

Fecha de publicación: 20 de Octubre de 2003  
 Fecha de Información: 16 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\$126.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	34.9	41.2	7.2	0.9	42.1
15 a 35	55.8	36.9	6.1	25.0	61.9
36 a 60	4.1	2.7	0.7	2.1	4.8
61 a 90	0.0	6.6	6.6	-	6.6
91 a 180	-	1.1	1.1	-	1.1
>180	10.0	10.0	-	-	10.0
<b>Total</b>	<b>104.8</b>	<b>98.7</b>	<b>21.8</b>	<b>28.0</b>	<b>126.7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	6.7 %	4.5 %
15 a 35	8.9 %	8.1 %
36 a 60	10.6 %	8.5 %
61 a 90	10.0 %	10.0 %
91 a 180	10.3 %	10.3 %
>180	9.3 %	9.3 %
<b>Total</b>	<b>9.0 %</b>	<b>7.2 %</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	13 al 17 de Octubre				20 al 24 de Octubre				27 al 31 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	26	48	410	292	45	62	454	326	20	28	231	202
<b>Real</b>	42	19	65	184	46	29	121	249	15	7	75	104
<b>Total</b>	68	68	476	476	91	91	575	575	35	35	306	306

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (\text{Plazo}/365)) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 17 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.