

Fecha de publicación: 21 de Octubre de 2003  
 Fecha de Información: 17 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\$137.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	7.9	9.2	9.2	7.9	17.1
15 a 35	82.4	23.6	10.6	69.4	93.0
36 a 60	-	9.6	9.6	-	9.6
61 a 90	0.9	13.1	13.1	0.9	14.0
91 a 180	-	3.5	3.5	-	3.5
>180	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>91.2</b>	<b>59.0</b>	<b>46.0</b>	<b>78.2</b>	<b>137.3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	4.0 %	10.1 %
15 a 35	9.6 %	9.8 %
36 a 60	9.2 %	9.2 %
61 a 90	9.3 %	9.2 %
91 a 180	9.5 %	9.4 %
>180	-	-
<b>Total</b>	<b>8.6 %</b>	<b>9.7 %</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	48	62	459	329	20	28	231	208
<b>Real</b>	42	19	65	184	46	32	124	254	15	7	81	104
<b>Total</b>	68	68	476	476	94	94	583	583	35	35	312	312

\* 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 20 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.