

Fecha de publicación: 23 de Octubre de 2003  
 Fecha de Información: 21 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\$154.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	39.9	46.0	11.0	4.9	50.9
15 a 35	80.0	20.2	12.7	72.5	92.7
36 a 60	5.0	0.9	0.9	5.0	5.9
61 a 90	-	1.2	1.2	-	1.2
91 a 180	1.0	2.5	1.4	-	2.5
>180	1.0	0.1	0.1	1.0	1.1
<b>Total</b>	<b>127.0</b>	<b>70.9</b>	<b>27.3</b>	<b>83.4</b>	<b>154.3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.6 %	10.0 %
15 a 35	9.3 %	9.4 %
36 a 60	10.8 %	9.8 %
61 a 90	10.1 %	10.2 %
91 a 180	9.6 %	9.7 %
>180	9.6 %	9.0 %
<b>Total</b>	<b>9.5 %</b>	<b>9.6 %</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	20 al 24 de Octubre				27 al 31 de Octubre				3 al 7 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	49	62	499	399	31	28	274	261	4	16	261	159
<b>Real</b>	46	33	174	274	15	18	92	104	14	2	38	140
<b>Total</b>	94	94	673	673	46	46	366	366	18	18	299	299

\* 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 22 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.