

Fecha de publicación: 27 de Octubre de 2003  
 Fecha de Información: 23 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\$138.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	30.0	29.0	19.0	20.0	49.0
15 a 35	75.5	25.0	0.0	50.5	75.5
36 a 60	2.0	-	-	2.0	2.0
61 a 90	6.0	6.1	0.1	0.1	6.1
91 a 180	5.7	6.0	0.3	-	6.0
>180	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>119.1</b>	<b>66.1</b>	<b>19.5</b>	<b>72.5</b>	<b>138.6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	3.6 %	6.5 %
15 a 35	9.1 %	9.0 %
36 a 60	9.7 %	9.7 %
61 a 90	9.3 %	9.7 %
91 a 180	10.2 %	9.6 %
>180	-	-
<b>Total</b>	<b>8.2 %</b>	<b>8.2 %</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	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	400	35	28	309	302	11	16	285	185
<b>Real</b>	46	33	174	274	15	22	113	120	14	9	44	143
<b>Total</b>	94	94	673	673	50	50	422	422	25	25	328	328

\* 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 24 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.