

Fecha de publicación: 30 de Octubre de 2003  
 Fecha de Información: 28 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\$53.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	10.3	8.0	0.0	2.3	10.3
15 a 35	32.0	28.3	3.1	6.8	35.0
36 a 60	5.0	5.2	0.2	-	5.2
61 a 90	0.1	0.2	0.2	0.1	0.2
91 a 180	2.1	0.3	0.2	2.0	2.3
>180	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>49.5</b>	<b>41.9</b>	<b>3.6</b>	<b>11.2</b>	<b>53.1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	6.1 %	8.5 %
15 a 35	9.4 %	9.6 %
36 a 60	8.6 %	9.2 %
61 a 90	9.1 %	9.1 %
91 a 180	9.4 %	9.2 %
>180	-	-
<b>Total</b>	<b>8.6 %</b>	<b>9.3 %</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**

Sector	27 al 31 de Octubre				3 al 7 de Noviembre				10 al 14 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	42	28	335	333	22	16	326	223	27	54	320	201
<b>Real</b>	15	29	121	123	15	20	45	148	39	13	91	209
<b>Total</b>	58	58	456	456	37	37	371	371	66	66	410	410

\* 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 29 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.