

Fecha de publicación: 31 de Octubre de 2003  
 Fecha de Información: 29 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\$124.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	2.5	29.6	29.6	2.5	32.1
15 a 35	29.0	28.0	16.0	17.0	45.0
36 a 60	-	4.6	4.6	-	4.6
61 a 90	-	12.3	12.3	-	12.3
91 a 180	6.3	4.3	0.5	2.5	6.8
>180	10.0	14.2	14.2	10.0	24.2
<b>Total</b>	<b>47.7</b>	<b>92.9</b>	<b>77.1</b>	<b>31.9</b>	<b>124.9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.4 %	8.9 %
15 a 35	8.7 %	9.0 %
36 a 60	9.7 %	8.9 %
61 a 90	9.8 %	9.5 %
91 a 180	9.3 %	9.0 %
>180	9.7 %	9.8 %
<b>Total</b>	<b>9.3 %</b>	<b>9.2 %</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	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>	43	28	335	333	26	17	326	252	32	64	326	209
<b>Real</b>	15	29	121	123	15	24	74	148	44	13	97	213
<b>Total</b>	58	58	456	456	41	41	400	400	77	77	422	422

\* 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 30 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.