

Fecha de publicación: 5 de Noviembre de 2003  
 Fecha de Información: 31 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\$78.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	42.3	38.0	1.0	5.3	43.4
15 a 35	17.3	16.1	4.8	6.0	22.0
36 a 60	1.7	-	-	1.7	1.7
61 a 90	-	1.0	1.0	-	1.0
91 a 180	-	3.2	3.2	-	3.2
>180	4.3	2.6	2.6	4.3	6.9
<b>Total</b>	<b>65.6</b>	<b>60.9</b>	<b>12.6</b>	<b>17.3</b>	<b>78.2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8.9 %	10.2 %
15 a 35	9.2 %	9.1 %
36 a 60	9.4 %	9.4 %
61 a 90	8.9 %	8.9 %
91 a 180	10.0 %	10.3 %
>180	9.9 %	9.7 %
<b>Total</b>	<b>9.3 %</b>	<b>9.8 %</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	42	17	354	310	36	64	341	225
<b>Real</b>	15	29	121	123	15	40	105	149	44	16	98	213
<b>Total</b>	58	58	456	456	57	57	459	459	80	80	439	439

\* 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 3 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.