

Fecha de publicación: 4 de Diciembre de 2003  
 Fecha de Información: 2 de Diciembre 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\$220.3 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	34.0	21.6	0.6	13.0	34.6
15 a 35	97.1	80.6	9.1	25.6	106.2
36 a 60	24.7	11.0	3.7	17.4	28.4
61 a 90	8.6	4.0	3.9	8.5	12.6
91 a 180	3.2	15.9	12.7	-	15.9
>180	0.1	22.7	22.6	-	22.7
<b>Total</b>	<b>167.7</b>	<b>155.8</b>	<b>52.6</b>	<b>64.5</b>	<b>220.3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9.2 %	10.7 %
15 a 35	9.9 %	9.9 %
36 a 60	9.3 %	9.0 %
61 a 90	9.7 %	9.7 %
91 a 180	9.7 %	9.7 %
>180	9.6 %	9.4 %
<b>Total</b>	<b>9.6 %</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	1 al 5 de Diciembre				8 al 12 de Diciembre				15 al 19 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	59	38	465	359	14	29	444	301	29	41	330	240
<b>Real</b>	35	56	110	216	28	14	92	235	33	21	87	176
<b>Total</b>	94	94	575	575	42	42	537	537	62	62	416	416

\* 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 diciembre se presenta la proyección de vencimientos.