

Fecha de publicación: 19 de diciembre de 2003  
 Fecha de Información: 17 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\$106.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10.5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	39.3	30.1	4.1	13.3	43.4
15-35	51.0	34.6	2.6	19.0	53.6
36-60	5.5	4.4	2.4	3.5	7.9
61-90	-	0.2	0.2	-	0.2
91-180	-	0.9	0.9	-	0.9
>180	-	0.2	0.2	-	0.2
<b>Total</b>	<b>95.8</b>	<b>70.4</b>	<b>10.4</b>	<b>35.8</b>	<b>106.2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	15.0 %	12.5 %
15-35	9.4 %	9.0 %
36-60	10.2 %	10.2 %
61-90	9.9 %	9.7 %
91-180	9.9 %	9.8 %
>180	10.0 %	10.0 %
<b>Total</b>	<b>10.7 %</b>	<b>10.5 %</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	15 al 19 de Diciembre				22 al 26 de Diciembre				29 de Dic. al 2 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	63	44	465	289	21	24	293	335	12	11	319	428
<b>Real</b>	36	54	105	281	19	16	115	73	6	7	189	81
<b>Total</b>	98	98	570	570	40	40	409	409	18	18	508	508

\* 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 18 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.