

Fecha de publicación: 23 de diciembre de 2003  
 Fecha de Información: 19 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\$76.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	16.0	3.6	1.1	13.5	17.1
15-35	45.7	33.6	0.7	12.8	46.4
36-60	9.0	6.3	0.3	3.0	9.3
61-90	0.2	1.2	1.2	0.2	1.4
91-180	-	2.6	2.6	-	2.6
>180	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>70.9</b>	<b>47.3</b>	<b>5.9</b>	<b>29.5</b>	<b>76.8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	12.9 %	11.5 %
15-35	9.0 %	8.8 %
36-60	9.3 %	9.0 %
61-90	10.1 %	10.3 %
91-180	9.8 %	9.9 %
>180	-	-
<b>Total</b>	<b>10.2 %</b>	<b>9.5 %</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>	62	44	465	289	36	25	296	329	14	11	315	424
<b>Real</b>	36	54	105	281	20	31	108	75	6	9	189	81
<b>Total</b>	98	98	570	570	56	56	404	404	20	20	504	504

\* 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 22 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.