

Fecha de publicación: 30 de diciembre de 2003  
 Fecha de Información: 26 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\$55.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9.9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	8.5	9.8	1.3	-	9.8
15-35	31.9	16.5	3.0	18.4	34.8
36-60	-	0.1	0.1	-	0.1
61-90	0.5	0.6	0.1	-	0.6
91-180	3.4	4.0	0.5	-	4.0
>180	6.0	6.1	0.1	-	6.1
<b>Total</b>	<b>50.3</b>	<b>37.0</b>	<b>5.1</b>	<b>18.4</b>	<b>55.3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	13.3 %	11.7 %
15-35	10.1 %	9.6 %
36-60	10.2 %	10.2 %
61-90	8.4 %	9.9 %
91-180	10.2 %	9.4 %
>180	1.5 %	9.3 %
<b>Total</b>	<b>9.5 %</b>	<b>9.9 %</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	22 al 26 de Diciembre				29 de Dic. al 2 de Enero				5 al 9 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	38	25	296	329	45	24	342	436	13	49	543	323
<b>Real</b>	20	33	108	75	8	28	190	96	47	11	89	309
<b>Total</b>	57	57	404	404	52	52	532	532	59	59	632	632

\* 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 29 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.