

Fecha de publicación: 9 de Enero de 2004  
 Fecha de Información: 7 de Enero de 2004 <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\$248.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8.8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	23.4	25.9	20.9	18.4	44.3
15-35	122.9	71.2	9.4	61.1	132.3
36-60	8.0	0.5	0.5	8.0	8.5
61-90	21.7	35.6	27.3	13.4	49.0
91-180	-	2.9	2.9	-	2.9
>180	9.0	6.1	2.1	5.0	11.1
<b>Total</b>	<b>185.0</b>	<b>142.3</b>	<b>63.2</b>	<b>105.9</b>	<b>248.3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	9.3 %	9.1 %
15-35	8.3 %	8.4 %
36-60	9.4 %	8.3 %
61-90	9.3 %	9.6 %
91-180	9.8 %	9.6 %
>180	9.3 %	9.0 %
<b>Total</b>	<b>9.0 %</b>	<b>8.8 %</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	5 al 9 de Enero				12 al 16 de Enero				19 al 23 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	17	51	628	395	24	24	407	310	19	32	219	156
<b>Real</b>	48	13	106	339	24	23	101	197	22	8	43	106
<b>Total</b>	64	64	733	733	48	48	507	507	40	40	262	262

\* 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 8 de enero se presenta la proyección de vencimientos.