

2 de Diciembre de 2002 <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\$157,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,5%.<sup>2</sup>

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

| Rango        | Sector Interbancario |             | Sector Real |             | Total        |
|--------------|----------------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
|              | Compras              | Ventas      | Compras     | Ventas      |              |
| 3 a 14       | 9,7                  | 6,5         | 1,0         | 4,2         | 10,7         |
| 15 a 35      | 39,6                 | 12,4        | 1,4         | 28,6        | 41,0         |
| 36 a 60      | 48,2                 | 70,1        | 25,1        | 3,2         | 73,3         |
| 61 a 90      | 18,1                 | 5,5         | 0,5         | 13,1        | 18,6         |
| 91 a 180     | 3,0                  | 3,3         | 1,3         | 1,0         | 4,3          |
| > 180        | 9,2                  | -           | -           | 9,2         | 9,2          |
| <b>Total</b> | <b>127,8</b>         | <b>97,8</b> | <b>29,3</b> | <b>59,3</b> | <b>157,1</b> |

\* Cifras en millones de dólares

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

| Rango        | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3 a 14       | 10,0 %          | 2,6 %                        |
| 15 a 35      | 4,2 %           | 0,4 %                        |
| 36 a 60      | 2,6 %           | 0,3 %                        |
| 61 a 90      | 4,5 %           | 5,2 %                        |
| 91 a 180     | 5,3 %           | 4,0 %                        |
| > 180        | 5,7 %           | 5,9 %                        |
| <b>Total</b> | <b>5,0 %</b>    | <b>1,5 %</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**

| Sector               | 2 al 6 de Diciembre |     |     |     | 9 al 13 de Diciembre |     |     |     | 16 al 20 de Diciembre |     |     |     |
|----------------------|---------------------|-----|-----|-----|----------------------|-----|-----|-----|-----------------------|-----|-----|-----|
|                      | Delivery            |     | NDF |     | Delivery             |     | NDF |     | Delivery              |     | NDF |     |
|                      | C                   | V   | C   | V   | C                    | V   | C   | V   | C                     | V   | C   | V   |
| <b>Interbancario</b> | 80                  | 84  | 281 | 246 | 46                   | 140 | 196 | 159 | 69                    | 97  | 235 | 221 |
| <b>Real</b>          | 19                  | 15  | 116 | 151 | 99                   | 6   | 73  | 110 | 38                    | 10  | 131 | 145 |
| <b>Total</b>         | 100                 | 100 | 397 | 397 | 146                  | 146 | 269 | 269 | 107                   | 107 | 366 | 366 |

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio Datatec}) \wedge (\text{Plazo}/360)) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 3 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.