

4 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\$127,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	20,9	50,4	32,7	3,2	53,6
15 a 35	35,3	51,4	20,6	4,5	55,9
36 a 60	5,5	3,0	0,0	2,5	5,5
61 a 90	0,7	0,3	0,3	0,7	1,0
91 a 180	-	0,2	0,2	-	0,2
> 180	11,1	0,1	0,1	11,1	11,1
<b>Total</b>	<b>73,4</b>	<b>105,5</b>	<b>54,0</b>	<b>22,0</b>	<b>127,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	5,0 %	10,4 %
15 a 35	2,7 %	3,1 %
36 a 60	2,5 %	4,2 %
61 a 90	3,3 %	3,2 %
91 a 180	5,3 %	5,7 %
> 180	4,5 %	6,0 %
<b>Total</b>	<b>4,0 %</b>	<b>6,5 %</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	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>	86	89	282	247	60	152	214	188	73	102	243	246
<b>Real</b>	19	16	116	151	99	7	90	116	38	10	148	146
<b>Total</b>	105	105	398	398	159	159	304	304	112	112	392	392

\* 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 5 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.