

9 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\$80,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -1,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	6,2	30,5	25,5	1,2	31,7
15 a 35	42,0	30,0	1,0	13,0	43,0
36 a 60	3,0	3,0	-	-	3,0
61 a 90	-	-	-	-	-
91 a 180	2,7	0,0	0,0	2,7	2,7
> 180	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>53,9</b>	<b>63,5</b>	<b>26,5</b>	<b>16,9</b>	<b>80,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	0,7 %	-11,8 %
15 a 35	5,3 %	5,5 %
36 a 60	6,1 %	6,4 %
61 a 90	0,0 %	-
91 a 180	5,0 %	3,9 %
> 180	-	-
<b>Total</b>	<b>4,3 %</b>	<b>-1,3 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para esta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sector	9 al 13 de Diciembre				16 al 20 de Diciembre				23 al 27 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Interbancario</b>	61	152	228	203	91	111	260	281	22	32	196	187
<b>Real</b>	99	9	102	127	38	18	169	147	15	4	105	115
<b>Total</b>	160	160	330	330	129	129	429	429	37	37	301	301

\* 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 10 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.