

12 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\$39,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	9,8	14,0	5,0	0,8	14,8
15 a 35	5,7	14,1	8,6	0,2	14,3
36 a 60	2,1	1,9	0,9	1,1	3,0
61 a 90	1,3	1,4	1,1	1,0	2,4
91 a 180	3,1	3,9	1,9	1,1	5,0
> 180	-	0,1	0,1	-	0,1
<b>Total</b>	<b>22,0</b>	<b>35,4</b>	<b>17,6</b>	<b>4,2</b>	<b>39,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-3,7 %	-8,7 %
15 a 35	5,4 %	10,1 %
36 a 60	11,6 %	6,6 %
61 a 90	4,7 %	4,4 %
91 a 180	4,9 %	3,7 %
> 180	0,5 %	0,5 %
<b>Total</b>	<b>5,0 %</b>	<b>1,6 %</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	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>	62	152	228	203	101	116	292	301	26	33	208	198
<b>Real</b>	99	10	102	127	38	23	173	165	15	8	114	124
<b>Total</b>	161	161	330	330	139	139	465	465	41	41	322	322

\* 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 13 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.