

18 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\$104,6 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	25,9	12,5	12,1	25,5	38,0
15 a 35	17,7	46,2	33,2	4,7	50,9
36 a 60	3,0	2,5	2,5	3,0	5,5
61 a 90	3,0	3,0	0,0	0,0	3,0
91 a 180	2,0	0,4	0,4	2,0	2,4
> 180	4,5	0,3	0,3	4,5	4,8
<b>Total</b>	<b>56,0</b>	<b>64,9</b>	<b>48,6</b>	<b>39,7</b>	<b>104,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-1,2 %	-4,4 %
15 a 35	4,5 %	4,8 %
36 a 60	4,9 %	5,0 %
61 a 90	2,5 %	6,2 %
91 a 180	4,6 %	4,1 %
> 180	2,5 %	5,7 %
<b>Total</b>	<b>2,1 %</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	16 al 20 de Diciembre				23 al 27 de Diciembre				30 de Dic. al 3 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Interbancario</b>	129	158	300	320	39	41	254	222	31	47	83	85
<b>Real</b>	53	25	187	168	16	15	127	158	19	3	29	27
<b>Total</b>	183	183	488	488	56	56	381	381	50	50	112	112

\* 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 19 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.