

5 de Noviembre 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\$64,0 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	12,6	11,0	-	1,6	12,6
15 a 35	10,4	13,5	6,2	3,1	16,6
36 a 60	-	0,4	0,4	-	0,4
61 a 90	0,1	22,7	22,7	0,1	22,8
91 a 180	-	2,1	2,1	-	2,1
> 180	8,8	0,7	0,7	8,8	9,6
<b>Total</b>	<b>31,9</b>	<b>50,4</b>	<b>32,1</b>	<b>13,6</b>	<b>64,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-2,6 %	-0,8 %
15 a 35	-1,5 %	-1,5 %
36 a 60	1,0 %	1,0 %
61 a 90	2,1 %	3,0 %
91 a 180	2,3 %	2,2 %
> 180	4,4 %	4,4 %
<b>Total</b>	<b>0,5 %</b>	<b>1,3 %</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	28 de Oct. al 1 de Noviembre				5 al 8 de Noviembre				12 al 15 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Interbancario</b>	42	58	204	198	57	71	242	206	29	36	139	107
<b>Real</b>	22	6	77	83	29	15	90	125	15	8	38	69
<b>Total</b>	64	64	281	281	86	86	331	331	44	44	177	177

\* 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 6 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.