

15 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\$136,7 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	22,4	5,7	3,2	19,9	25,6
15 a 35	47,0	33,5	12,0	25,5	59,0
36 a 60	3,5	6,3	2,8	-	6,3
61 a 90	11,6	17,1	10,6	5,1	22,2
91 a 180	3,3	16,7	13,6	0,3	16,9
> 180	1,5	5,2	5,2	1,5	6,7
<b>Total</b>	<b>89,4</b>	<b>84,4</b>	<b>47,3</b>	<b>52,3</b>	<b>136,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-7,8 %	-8,4 %
15 a 35	0,6 %	-1,5 %
36 a 60	0,7 %	-1,1 %
61 a 90	2,5 %	2,7 %
91 a 180	2,9 %	2,9 %
> 180	4,0 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>1,2 %</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**

Sector	12 al 15 de Noviembre				18 al 22 de Noviembre				25 al 29 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Interbancario</b>	35	47	149	109	47	61	205	227	30	52	287	240
<b>Real</b>	21	9	39	78	26	12	110	88	28	6	60	107
<b>Total</b>	55	55	188	188	72	72	315	315	58	58	347	347

\* 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 18 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.