

18 de Octubre de 2002 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pacto un total de US\$62,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	14,3	7,4	1,1	8,0	15,4
15 a 35	3,8	4,8	2,5	1,5	6,3
36 a 60	10,1	1,4	1,3	10,0	11,4
61 a 90	5,4	4,6	1,4	2,2	6,8
91 a 180	16,0	13,1	6,1	9,0	22,1
> 180	0,6	0,0	0,0	0,6	0,6
<b>Total</b>	<b>50,1</b>	<b>31,2</b>	<b>12,4</b>	<b>31,3</b>	<b>62,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por
3 a 14	-4,0 %	-1,0 %
15 a 35	-3,6 %	0,4 %
36 a 60	-2,1 %	-4,0 %
61 a 90	0,6 %	-0,1 %
91 a 180	2,7 %	3,2 %
> 180	4,0 %	4,0 %
<b>Total</b>	<b>-0,7 %</b>	<b>0,2 %</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	15 al 18 de Octubre				21 al 25 de Octubre				28 de Oct. al 1 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Interbancario</b>	42	66	256	246	50	77	246	175	23	28	159	172
<b>Real</b>	31	8	61	71	36	9	66	138	10	4	76	63
<b>Total</b>	73	73	317	317	86	86	313	313	33	33	235	235

\* 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 21 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.