

25 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 pactó un total de US\$79,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	36,5	30,6	0,0	5,9	36,5
15 a 35	21,0	30,4	12,2	2,8	33,2
36 a 60	0,0	1,0	1,0	0,0	1,0
61 a 90	2,1	4,0	2,0	0,2	4,1
91 a 180	0,0	4,4	4,4	0,0	4,4
> 180	0,0	0,3	0,3	0,0	0,3
<b>Total</b>	<b>59,6</b>	<b>70,6</b>	<b>19,9</b>	<b>8,9</b>	<b>79,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-1,3 %	-1,8 %
15 a 35	2,0 %	1,2 %
36 a 60	2,4 %	2,4 %
61 a 90	1,7 %	0,7 %
91 a 180	3,1 %	2,8 %
> 180	4,5 %	4,5 %
<b>Total</b>	<b>1,3 %</b>	<b>-0,1 %</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	21 al 25 de Octubre				28 de Oct. al 1 de Noviembre				4 al 8 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Interbancario</b>	52	77	249	176	42	58	198	198	52	58	236	181
<b>Real</b>	36	11	66	140	22	6	77	77	18	13	69	124
<b>Total</b>	88	88	316	316	64	64	275	275	70	70	305	305

\* 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 28 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.