

8 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\$49,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	6,3	4,3	0,3	2,3	6,5
15 a 35	27,5	33,6	6,1	-	33,6
36 a 60	-	-	-	-	-
61 a 90	8,0	8,1	0,1	-	8,1
91 a 180	-	0,3	0,3	-	0,3
> 180	0,4	-	-	0,4	0,4
<b>Total</b>	<b>42,2</b>	<b>46,2</b>	<b>6,7</b>	<b>2,7</b>	<b>49,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	1,8 %	-2,1 %
15 a 35	1,2 %	2,3 %
36 a 60	0,0 %	-
61 a 90	2,8 %	2,3 %
91 a 180	4,1 %	4,2 %
> 180	3,8 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>1,9 %</b>	<b>1,7 %</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	5 al 8 de Noviembre				12 al 15 de Noviembre				18 al 22 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Interbancario</b>	57	71	242	206	32	44	149	109	33	48	202	222
<b>Real</b>	29	15	90	125	21	9	39	78	25	9	106	86
<b>Total</b>	86	86	331	331	52	52	188	188	57	57	308	308

\* 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 11 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.