

14 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\$107,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	16,0	14,2	2,6	4,4	18,6
15 a 35	17,1	29,7	13,2	0,6	30,3
36 a 60	-	6,0	6,0	-	6,0
61 a 90	25,0	36,9	13,9	2,0	38,9
91 a 180	9,0	4,1	2,1	7,0	11,1
> 180	-	2,5	2,5	-	2,5
<b>Total</b>	<b>67,1</b>	<b>93,4</b>	<b>40,3</b>	<b>14,0</b>	<b>107,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

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

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	45	59	203	227	29	50	268	238
<b>Real</b>	21	9	39	78	25	11	110	86	26	6	59	89
<b>Total</b>	55	55	188	188	71	71	313	313	56	56	327	327

\* 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 15 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.