

22 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\$96,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	37,1	31,1	0,1	6,1	37,2
15 a 35	19,2	26,5	10,5	3,2	29,7
36 a 60	3,7	3,2	0,6	1,1	4,3
61 a 90	21,6	22,8	1,2	-	22,8
91 a 180	-	0,5	0,5	-	0,5
> 180	2,0	2,0	-	-	2,0
<b>Total</b>	<b>83,5</b>	<b>86,1</b>	<b>12,9</b>	<b>10,3</b>	<b>96,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9,8 %	0,8 %
15 a 35	5,5 %	2,4 %
36 a 60	2,7 %	1,3 %
61 a 90	5,2 %	6,5 %
91 a 180	5,1 %	5,6 %
> 180	6,5 %	6,5 %
<b>Total</b>	<b>6,5 %</b>	<b>2,8 %</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	18 al 22 de Noviembre				25 al 29 de Noviembre				2 al 6 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Interbancario</b>	47	61	207	227	74	84	324	277	36	52	235	146
<b>Real</b>	26	12	109	89	31	20	62	108	19	4	62	151
<b>Total</b>	73	73	316	316	104	104	385	385	55	55	297	297

\* 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 25 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.