

17 de Diciembre 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\$40,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	9,9	6,8	1,4	4,6	11,3
15 a 35	8,0	18,0	10,0	-	18,0
36 a 60	2,0	1,0	-	1,0	2,0
61 a 90	4,0	5,5	1,5	-	5,5
91 a 180	-	1,6	1,6	-	1,6
> 180	1,5	0,2	0,2	1,5	1,7
<b>Total</b>	<b>25,4</b>	<b>33,1</b>	<b>14,7</b>	<b>7,1</b>	<b>40,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	2,0 %	2,2 %
15 a 35	0,9 %	-0,5 %
36 a 60	3,7 %	3,7 %
61 a 90	5,6 %	5,1 %
91 a 180	5,8 %	5,1 %
> 180	4,5 %	5,9 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>1,8 %</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	16 al 20 de Diciembre				23 al 27 de Diciembre				30 de Dic. al 3 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Interbancario</b>	129	158	300	320	38	40	232	210	31	47	77	85
<b>Real</b>	53	25	187	168	16	14	115	136	19	3	29	21
<b>Total</b>	183	183	488	488	54	54	346	346	50	50	106	106

\* 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 18 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.