

20 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\$60,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	9,9	20,1	14,6	4,4	24,5
15 a 35	18,5	14,7	2,7	6,5	21,2
36 a 60	10,5	10,8	0,8	0,5	11,3
61 a 90	2,5	0,2	0,2	2,5	2,7
91 a 180	-	0,3	0,3	-	0,3
> 180	-	0,0	0,0	-	0,0
<b>Total</b>	<b>41,4</b>	<b>46,1</b>	<b>18,6</b>	<b>13,9</b>	<b>60,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	0,8 %	-3,8 %
15 a 35	4,5 %	5,6 %
36 a 60	3,7 %	3,0 %
61 a 90	2,7 %	5,0 %
91 a 180	5,4 %	5,3 %
> 180	0,3 %	0,3 %
<b>Total</b>	<b>2,3 %</b>	<b>1,3 %</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	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	45	50	261	247	32	48	89	86
<b>Real</b>	53	25	187	168	20	16	149	162	19	3	29	32
<b>Total</b>	183	183	488	488	65	65	410	410	51	51	119	119

\* 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 23 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.