

3 de Enero de 2003 <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\$14,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -4,0%.<sup>2</sup>

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

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

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-6,2 %	-8,2 %
15 a 35	4,7 %	2,7 %
36 a 60	5,3 %	4,1 %
61 a 90	0,0 %	-
91 a 180	5,6 %	5,7 %
> 180	-	-
<b>Total</b>	<b>1,7 %</b>	<b>-4,0 %</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	30 de Dic. al 3 de Enero				7 al 10 de Enero				13 al 17 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Interbancario</b>	56	67	128	156	64	86	300	294	65	47	289	281
<b>Real</b>	19	8	86	58	34	12	138	144	18	36	157	165
<b>Total</b>	75	75	214	214	98	98	438	438	83	83	446	446

\* 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 6 de enero se presenta la proyección de vencimientos.