

27 de Diciembre de 2002 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$142,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	66,5	46,3	27,3	47,5	93,8
15 a 35	12,5	12,7	3,4	3,2	15,9
36 a 60	16,7	16,0	-	0,7	16,7
61 a 90	2,0	2,1	0,1	-	2,1
91 a 180	14,0	0,2	0,2	14,0	14,2
> 180	-	-	-	-	-
Total	111,7	77,3	31,0	65,4	142,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8,0 %	8,5 %
15 a 35	5,3 %	8,1 %
36 a 60	7,5 %	9,8 %
61 a 90	4,6 %	4,6 %
91 a 180	5,0 %	4,5 %
> 180	-	-
Total	6,5 %	8,2 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	23 al 27 de Diciembre				30 de Dic. al 3 de Enero				6 al 10 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	49	53	288	276	56	67	128	156	62	75	297	262
Real	20	16	178	189	19	8	86	58	24	11	106	141
Total	69	69	466	466	75	75	214	214	86	86	403	403

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio Datatec})^{\wedge} (\text{Plazo}/360)) - 1$

³ A partir del 30 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.