

16 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\$78,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -4,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	22,0	44,9	29,1	6,2	51,1
15 a 35	10,1	10,5	0,5	0,1	10,7
36 a 60	-	7,5	7,5	-	7,5
61 a 90	0,6	0,8	0,6	0,5	1,3
91 a 180	-	0,2	0,2	-	0,2
> 180	7,5	-	-	7,5	7,5
Total	40,3	63,9	38,0	14,3	78,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

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
Interbancario	129	158	300	320	37	38	226	209	27	33	77	85
Real	53	25	187	168	15	14	114	131	9	3	29	21
Total	183	183	488	488	52	52	340	340	36	36	106	106

* 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 17 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.