

23 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\$125,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	37,1	58,2	51,0	29,9	88,1
15 a 35	21,7	29,0	8,4	1,1	30,1
36 a 60	7,0	-	-	7,0	7,0
61 a 90	-	0,0	0,0	-	0,0
91 a 180	-	0,0	0,0	-	0,0
> 180	-	0,0	0,0	-	0,0
Total	65,8	87,3	59,5	38,0	125,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	38	52	89	108	36	53	275	258
Real	20	16	178	189	19	5	51	32	22	5	106	123
Total	69	69	466	466	57	57	141	141	59	59	381	381

* 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 24 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.