

30 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\$86,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	6,6	36,2	33,5	3,9	40,1
15 a 35	4,8	10,8	9,0	3,0	13,8
36 a 60	27,8	5,0	5,0	27,8	32,8
61 a 90	-	0,0	0,0	-	0,0
91 a 180	-	0,0	0,0	-	0,0
> 180	-	-	-	-	-
Total	39,2	52,0	47,5	34,7	86,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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
Interbancario	56	67	128	156	63	75	300	294	65	47	280	281
Real	19	8	86	58	24	11	138	144	18	36	157	156
Total	75	75	214	214	86	86	438	438	83	83	437	437

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

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

³ A partir del 31 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.