

2 de Enero de 2003 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\$22,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	2,2	11,2	10,2	1,2	12,4
15 a 35	10,0	10,2	0,2	-	10,2
36 a 60	-	-	-	-	-
61 a 90	-	0,0	0,0	-	0,0
91 a 180	-	0,1	0,1	-	0,1
> 180	-	-	-	-	-
Total	12,2	21,5	10,5	1,2	22,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-2,7 %	11,2 %
15 a 35	7,1 %	6,8 %
36 a 60	0,0 %	-
61 a 90	6,0 %	6,0 %
91 a 180	5,6 %	5,6 %
> 180	-	-
Total	1,9 %	9,2 %

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

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
Interbancario	56	67	128	156	64	86	300	294	65	47	280	281
Real	19	8	86	58	34	12	138	144	18	36	157	156
Total	75	75	214	214	98	98	438	438	83	83	437	437

* 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 3 de enero se presenta la proyección de vencimientos.