

7 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\$82 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 15%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	12.9	21.5	15.5	6.9	28.4
15 a 35	19.3	16.6	1.6	4.3	20.8
36 a 60	16.0	22.0	11.0	5.0	27.0
61 a 90	-	5.0	5.0	-	5.0
91 a 180	-	0.4	0.4	-	0.4
> 180	-	0.0	0.0	-	0.0
Total	48.1	65.4	33.4	16.1	81.6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	25.3 %	30.4 %
15 a 35	4.3 %	5.5 %
36 a 60	7.5 %	7.2 %
61 a 90	6.3 %	5.0 %
91 a 180	7.0 %	7.1 %
> 180	-1.4 %	-1.4 %
Total	12.0 %	14.7 %

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	6 al 10 de Enero				13 al 17 de Enero				20 al 24 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	72	86	300	294	67	47	293	296	42	36	241	158
Real	34	20	138	144	18	37	172	169	21	26	75	158
Total	106	106	439	439	85	85	465	465	62	62	316	316

* 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 8 de enero se presenta la proyección de vencimientos.