

3 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\$103,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	26,6	22,5	-	4,1	26,6
15 a 35	31,0	39,0	8,0	-	39,0
36 a 60	9,8	9,0	-	0,8	9,8
61 a 90	24,5	16,0	0,0	8,5	24,5
91 a 180	1,5	3,5	2,0	-	3,5
> 180	-	0,0	0,0	-	0,0
Total	93,4	90,1	10,1	13,3	103,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8,4 %	12,0 %
15 a 35	-0,4 %	3,2 %
36 a 60	3,5 %	4,7 %
61 a 90	4,2 %	4,7 %
91 a 180	6,3 %	6,6 %
> 180	-0,9 %	-0,9 %
Total	4,0 %	6,1 %

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	2 al 6 de Diciembre				9 al 13 de Diciembre				16 al 20 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	86	89	282	247	53	146	207	168	70	98	237	223
Real	19	16	116	151	99	7	73	113	38	10	131	145
Total	105	105	398	398	153	153	280	280	108	108	368	368

* 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 4 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.