

5 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\$77,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	29,5	25,5	7,0	11,0	36,5
15 a 35	21,7	19,2	0,2	2,7	21,9
36 a 60	8,5	9,0	3,0	2,5	11,5
61 a 90	1,5	2,1	1,1	0,5	2,6
91 a 180	-	4,5	4,5	-	4,5
> 180	-	-	-	-	-
Total	61,2	60,4	15,9	16,7	77,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sectores	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	60	152	228	191	74	103	258	268
Real	19	16	116	151	99	7	90	127	38	10	155	146
Total	105	105	398	398	159	159	318	318	112	112	414	414

* 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 6 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.