

6 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\$44,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	14,0	4,0	-	10,0	14,0
15 a 35	19,1	10,5	2,5	11,1	21,6
36 a 60	3,5	3,9	3,9	3,5	7,4
61 a 90	-	0,5	0,5	-	0,5
91 a 180	-	0,1	0,1	-	0,1
> 180	-	1,0	1,0	-	1,0
Total	36,6	19,9	7,9	24,6	44,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	61	152	228	191	87	107	259	268
Real	19	16	116	151	99	8	90	127	38	18	155	146
Total	105	105	398	398	160	160	318	318	125	125	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 9 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.