

10 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 2,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	11,9	1,6	-	10,3	11,9
15 a 35	28,0	10,0	-	18,0	28,0
36 a 60	1,0	1,0	-	-	1,0
61 a 90	3,5	3,1	0,1	0,5	3,6
91 a 180	-	0,1	0,1	-	0,1
> 180	-	0,0	0,0	-	0,0
Total	44,4	15,7	0,1	28,8	44,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	9 al 13 de Diciembre				16 al 20 de Diciembre				23 al 27 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	62	152	228	203	92	111	268	281	26	33	206	188
Real	99	10	102	127	38	19	169	155	15	8	105	124
Total	161	161	330	330	131	131	437	437	41	41	311	311

* 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 11 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.