

11 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\$106,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	24,2	12,5	0,5	12,2	24,8
15 a 35	28,5	42,0	13,5	-	42,0
36 a 60	0,1	0,0	0,0	0,1	0,1
61 a 90	7,0	9,3	2,3	-	9,3
91 a 180	26,3	4,2	4,2	26,3	30,5
> 180	-	0,1	0,1	-	0,1
Total	86,1	68,1	20,6	38,6	106,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sectores	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	97	113	287	292	26	33	206	188
Real	99	10	102	127	38	23	169	164	15	8	105	124
Total	161	161	330	330	136	136	456	456	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 12 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.