

13 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\$137,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	44,2	31,6	-	12,6	44,2
15 a 35	11,2	34,1	26,1	3,2	37,2
36 a 60	13,6	13,6	0,6	0,6	14,2
61 a 90	0,6	0,1	0,1	0,6	0,7
91 a 180	8,0	8,3	3,3	3,0	11,3
> 180	30,0	0,1	0,1	30,0	30,1
Total	107,5	87,8	30,2	49,9	137,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

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	128	142	300	306	26	33	216	199
Real	99	10	102	127	38	25	173	168	15	8	114	131
Total	161	161	330	330	167	167	474	474	41	41	330	330

* 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 16 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.