

19 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\$63,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -3,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	9,7	16,5	12,0	5,2	21,7
15 a 35	19,0	19,6	2,1	1,5	21,1
36 a 60	16,0	16,0	-	-	16,0
61 a 90	-	0,1	0,1	-	0,1
91 a 180	-	1,7	1,7	-	1,7
> 180	2,0	0,8	0,8	2,0	2,8
Total	46,7	54,7	16,7	8,7	63,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	0,3 %	-19,3 %
15 a 35	3,5 %	3,6 %
36 a 60	6,8 %	6,8 %
61 a 90	3,8 %	3,8 %
91 a 180	4,8 %	4,4 %
> 180	6,2 %	5,5 %
Total	4,0 %	-3,3 %

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

Sectores	16 al 20 de Diciembre				23 al 27 de Diciembre				30 de Dic. al 3 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	129	158	300	320	40	43	257	235	32	48	88	85
Real	53	25	187	168	18	15	137	158	19	3	29	32
Total	183	183	488	488	59	59	394	394	51	51	117	117

* 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 20 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.