

24 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\$2,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	1,0	-	-	1,0	1,0
15 a 35	-	-	-	-	-
36 a 60	-	1,0	1,0	-	1,0
61 a 90	-	0,4	0,4	-	0,4
91 a 180	-	0,0	0,0	-	0,0
> 180	-	-	-	-	-
Total	1,0	1,4	1,4	1,0	2,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	23 al 27 de Diciembre				30 de Dic. al 3 de Enero				6 al 10 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	49	53	288	276	39	52	90	108	37	53	275	258
Real	20	16	178	189	19	6	51	33	22	6	106	123
Total	69	69	466	466	58	58	141	141	59	59	381	381

* 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 25 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.