

26 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\$81,6 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	34,8	43,0	10,0	1,8	44,8
15 a 35	1,7	1,0	-	0,7	1,7
36 a 60	8,0	8,0	-	-	8,0
61 a 90	1,1	4,5	4,5	1,1	5,6
91 a 180	5,5	6,6	1,6	0,5	7,1
> 180	11,1	3,3	3,3	11,1	14,3
Total	62,2	66,4	19,4	15,2	81,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	6,4 %	-0,5 %
15 a 35	5,6 %	4,1 %
36 a 60	5,2 %	5,0 %
61 a 90	2,8 %	6,8 %
91 a 180	4,4 %	5,4 %
> 180	4,2 %	5,8 %
Total	4,9 %	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	56	67	100	128	45	61	275	258
Real	20	16	178	189	19	8	61	33	22	6	106	123
Total	69	69	466	466	75	75	161	161	67	67	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 27 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.