

12 de Noviembre 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\$115,1 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	5,7	7,6	2,8	0,9	8,5
15 a 35	50,1	49,9	21,3	21,5	71,4
36 a 60	-	2,3	2,3	-	2,3
61 a 90	2,3	9,2	6,9	-	9,2
91 a 180	12,0	9,6	7,6	10,0	19,6
> 180	-	4,1	4,1	-	4,1
Total	70,1	82,7	45,0	32,4	115,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	0,2 %	-16,7 %
15 a 35	-0,7 %	-2,1 %
36 a 60	1,7 %	1,0 %
61 a 90	1,6 %	1,2 %
91 a 180	2,6 %	1,0 %
> 180	4,3 %	4,3 %
Total	1,3 %	-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

Sector	12 al 15 de Noviembre				18 al 22 de Noviembre				25 al 29 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	35	47	149	109	33	49	203	224	26	47	241	216
Real	21	9	39	78	25	9	107	86	26	6	53	79
Total	55	55	188	188	58	58	310	310	52	52	294	294

* 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 13 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.