

13 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\$98,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	16,7	8,0	-	8,7	16,7
15 a 35	33,6	39,0	10,0	4,6	43,6
36 a 60	1,0	12,5	11,5	-	12,5
61 a 90	1,2	1,5	1,0	0,7	2,2
91 a 180	13,1	7,2	4,2	10,0	17,2
> 180	5,4	6,3	1,3	0,4	6,7
Total	70,9	74,4	27,9	24,3	98,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	1,1 %	3,4 %
15 a 35	0,9 %	2,2 %
36 a 60	1,5 %	3,1 %
61 a 90	1,9 %	1,4 %
91 a 180	2,9 %	2,3 %
> 180	4,1 %	3,7 %
Total	2,2 %	2,6 %

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	34	49	203	224	28	49	255	222
Real	21	9	39	78	25	10	107	86	26	6	54	86
Total	55	55	188	188	59	59	310	310	55	55	308	308

* 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 14 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.