

18 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\$74,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	0,5	-	-	0,5	0,5
15 a 35	30,0	42,2	12,2	-	42,2
36 a 60	1,0	1,7	0,7	-	1,7
61 a 90	-	3,0	3,0	-	3,0
91 a 180	6,3	13,1	9,8	3,0	16,1
> 180	-	10,7	10,7	-	10,7
Total	37,8	70,6	36,2	3,5	74,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	0,3 %	-1,6 %
15 a 35	1,9 %	4,6 %
36 a 60	2,7 %	2,5 %
61 a 90	3,1 %	2,5 %
91 a 180	4,1 %	3,0 %
> 180	4,8 %	5,0 %
Total	3,3 %	4,2 %

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	18 al 22 de Noviembre				25 al 29 de Noviembre				2 al 6 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	47	61	206	227	30	52	287	240	29	41	201	132
Real	26	12	110	89	28	6	60	107	13	2	62	131
Total	72	72	316	316	59	59	347	347	42	42	263	263

* 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 19 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.