

20 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\$95,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	5,2	2,5	1,5	4,2	6,7
15 a 35	30,1	28,8	8,8	10,1	38,9
36 a 60	5,0	14,1	9,1	-	14,1
61 a 90	22,0	23,7	1,7	-	23,7
91 a 180	0,2	7,9	7,7	-	7,9
> 180	-	3,6	3,6	-	3,6
Total	62,5	80,7	32,5	14,3	95,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	207	227	33	54	315	269	33	43	227	141
Real	26	12	109	89	28	7	62	108	13	4	62	148
Total	73	73	316	316	61	61	377	377	46	46	289	289

* 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 21 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.