

25 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\$108,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 11,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	14,9	35,3	24,5	4,1	39,4
15 a 35	23,5	21,5	4,0	6,0	27,5
36 a 60	37,9	13,5	0,5	24,9	38,4
61 a 90	-	0,5	0,5	-	0,5
91 a 180	3,0	3,0	-	-	3,0
> 180	-	-	-	-	-
Total	79,4	73,9	29,5	35,0	108,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-3,7 %	29,8 %
15 a 35	2,9 %	-0,3 %
36 a 60	3,0 %	2,6 %
61 a 90	2,5 %	2,5 %
91 a 180	7,0 %	7,0 %
> 180	-	-
Total	1,0 %	11,8 %

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	25 al 29 de Noviembre				2 al 6 de Diciembre				9 al 13 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	74	85	325	283	39	52	245	180	42	99	184	140
Real	31	20	67	109	19	7	86	151	59	2	63	106
Total	105	105	392	392	59	59	331	331	101	101	246	246

* 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 26 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.