

21 de Octubre 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\$166,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	2,1	1,6	0,5	1,0	2,6
15 a 35	46,1	21,5	9,1	33,8	55,2
36 a 60	44,7	23,0	15,0	36,7	59,7
61 a 90	33,2	5,2	2,2	30,2	35,4
91 a 180	8,8	3,2	3,2	8,8	12,0
> 180	0,0	1,7	1,7	0,0	1,7
Total	134,8	56,3	31,8	110,3	166,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	21 al 25 de Octubre				28 de Oct. al 1 de Noviembre				4 al 8 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	50	77	248	175	23	28	160	174	40	47	206	163
Real	36	10	66	140	10	5	77	63	14	6	62	105
Total	86	86	315	315	33	33	237	237	53	53	268	268

* 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 22 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.