

22 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\$252,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	8,5	8,7	5,3	5,1	13,8
15 a 35	27,4	45,8	23,7	5,3	51,1
36 a 60	12,5	1,9	1,9	12,5	14,4
61 a 90	123,4	3,2	3,2	123,4	126,6
91 a 180	29,1	18,6	14,5	25,0	43,6
> 180	0,5	2,6	2,6	0,5	3,0
Total	201,5	80,8	51,1	171,8	252,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-15,3 %	-11,1 %
15 a 35	-1,8 %	-4,5 %
36 a 60	-1,2 %	-2,0 %
61 a 90	0,9 %	4,3 %
91 a 180	1,8 %	-1,3 %
> 180	3,1 %	3,2 %
Total	-0,9 %	0,4 %

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	52	77	249	176	24	29	162	176	40	48	214	170
Real	36	11	66	140	10	5	77	63	14	6	69	113
Total	88	88	316	316	34	34	239	239	54	54	283	283

* 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 23 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.