

23 de Octubre de 2002 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario, durante el día se pacto US\$116,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de - 0,8%.²

Cuadro No. 1

Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	28,7	36,5	15,5	7,7	44,2
15 a 35	9,0	14,4	9,4	4,0	18,4
36 a 60	10,1	6,5	5,5	9,0	15,5
61 a 90	3,0	5,2	4,2	2,0	7,2
91 a 180	16,1	14,7	10,5	11,9	26,5
> 180	1,3	3,0	3,0	1,3	4,2
Total	68,1	80,3	48,1	35,9	116,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	26	42	184	193	40	52	222	174
Real	36	11	66	140	22	6	77	68	18	6	69	117
Total	88	88	316	316	48	48	261	261	58	58	291	291

* 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 24 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.