

24 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\$91,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	19,2	3,6	0,2	15,8	19,4
15 a 35	41,1	42,3	1,7	0,5	42,8
36 a 60	1,1	7,6	6,5	0,0	7,6
61 a 90	1,7	10,5	10,5	1,7	12,3
91 a 180	4,3	7,1	2,9	0,1	7,2
> 180	0,0	2,7	2,7	0,0	2,7
Total	67,3	73,8	24,6	18,1	91,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-0,9 %	-2,7 %
15 a 35	1,6 %	1,4 %
36 a 60	2,7 %	2,4 %
61 a 90	1,7 %	1,0 %
91 a 180	3,4 %	2,2 %
> 180	4,7 %	4,9 %
Total	1,9 %	0,7 %

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

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	27	43	190	195	47	52	228	174
Real	36	11	66	140	22	6	77	72	18	12	69	123
Total	88	88	316	316	49	49	267	267	65	65	297	297

* 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 25 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.