

29 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\$45,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -2,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	12,6	3,5	0,5	9,6	13,1
15 a 35	14,6	18,9	7,4	3,1	22,0
36 a 60	2,0	0,1	0,1	2,0	2,1
61 a 90	4,5	0,5	0,5	4,5	5,0
91 a 180	2,2	0,5	0,3	2,0	2,5
> 180	0,0	0,8	0,8	0,0	0,8
Total	35,9	24,3	9,6	21,2	45,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	8,4 %	-10,0 %
15 a 35	-0,2 %	0,0 %
36 a 60	1,5 %	0,1 %
61 a 90	2,4 %	2,6 %
91 a 180	3,2 %	1,4 %
> 180	3,8 %	3,8 %
Total	2,5 %	-2,5 %

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	28 de Oct. al 1 de Noviembre				5 al 8 de Noviembre				12 al 15 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	42	58	204	198	53	60	237	190	17	25	130	102
Real	22	6	77	83	19	13	77	124	15	7	38	66
Total	64	64	281	281	72	72	314	314	32	32	168	168

* 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 30 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.