

31 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\$130,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	13,1	21,6	12,5	4,0	25,6
15 a 35	35,0	35,0	2,0	2,0	37,0
36 a 60	-	0,5	0,5	-	0,5
61 a 90	10,0	42,0	32,0	-	42,0
91 a 180	11,5	17,1	13,6	8,0	25,1
> 180	-	-	-	-	-
Total	69,6	116,2	60,6	14,0	130,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	1,9 %	2,2 %
15 a 35	-1,0 %	-2,1 %
36 a 60	1,4 %	1,4 %
61 a 90	2,5 %	2,7 %
91 a 180	3,5 %	3,6 %
> 180	-	-
Total	1,3 %	1,4 %

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	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	56	71	242	206	18	25	138	106
Real	22	6	77	83	29	14	90	125	15	8	38	69
Total	64	64	281	281	85	85	331	331	33	33	176	176

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio Datatec) ^ (Plazo/360)) - 1

³ A partir del 01 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.