

01 de Noviembre 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\$92,8 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	1,3	1,1	0,1	0,3	1,4
15 a 35	33,0	38,8	7,8	2,0	40,8
36 a 60	3,5	0,6	0,6	3,5	4,1
61 a 90	-	4,1	4,1	-	4,1
91 a 180	13,0	9,1	1,1	5,0	14,1
> 180	11,8	28,3	16,5	-	28,3
Total	62,6	82,1	30,3	10,8	92,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-2,2 %	-5,0 %
15 a 35	0,8 %	1,9 %
36 a 60	0,2 %	0,4 %
61 a 90	2,7 %	2,2 %
91 a 180	2,1 %	1,3 %
> 180	4,8 %	4,6 %
Total	1,1 %	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	57	71	242	206	20	27	137	105
Real	22	6	77	83	29	14	90	125	15	8	38	69
Total	64	64	281	281	85	85	331	331	35	35	175	175

* 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 04 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.