

6 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\$23,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -4,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	10,3	3,0	1,0	8,3	11,3
15 a 35	3,4	6,7	3,3	-	6,7
36 a 60	2,0	0,2	0,2	2,0	2,2
61 a 90	-	0,8	0,8	-	0,8
91 a 180	-	0,6	0,6	-	0,6
> 180	0,5	1,6	1,6	0,5	2,1
Total	16,2	12,8	7,5	10,8	23,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-9,7 %	-10,1 %
15 a 35	-0,2 %	-0,5 %
36 a 60	1,2 %	0,6 %
61 a 90	1,2 %	0,2 %
91 a 180	2,0 %	2,0 %
> 180	3,9 %	4,1 %
Total	-0,4 %	-4,5 %

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	5 al 8 de Noviembre				12 al 15 de Noviembre				18 al 22 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	57	71	242	206	31	39	147	107	25	43	177	194
Real	29	15	90	125	16	8	38	77	25	6	93	76
Total	86	86	331	331	47	47	185	185	50	50	270	270

* 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 7 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.