

7 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\$116,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -1,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	27,7	34,4	18,4	11,7	46,0
15 a 35	50,8	34,7	2,9	19,0	53,7
36 a 60	-	0,4	0,4	-	0,4
61 a 90	11,2	4,8	1,8	8,2	12,9
91 a 180	-	0,9	0,9	-	0,9
> 180	-	2,9	2,9	-	2,9
Total	89,6	78,1	27,3	38,8	116,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-3,1 %	-2,9 %
15 a 35	0,8 %	-0,2 %
36 a 60	1,0 %	1,0 %
61 a 90	1,1 %	0,8 %
91 a 180	3,0 %	2,9 %
> 180	4,7 %	4,9 %
Total	1,0 %	-1,0 %

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

Sector	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	70	242	206	32	43	149	109	26	44	202	222
Real	28	15	90	125	20	9	39	78	25	7	106	86
Total	85	85	331	331	52	52	188	188	51	51	308	308

* 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 8 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.