

19 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\$125,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	50,8	35,6	0,7	15,9	51,5
15 a 35	26,1	25,4	0,3	1,0	26,4
36 a 60	-	1,6	1,6	-	1,6
61 a 90	4,0	14,1	10,1	-	14,1
91 a 180	8,0	13,2	5,2	-	13,2
> 180	11,5	12,4	7,4	6,5	18,9
Total	100,4	102,2	25,2	23,4	125,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	4,8 %	1,7 %
15 a 35	2,6 %	3,2 %
36 a 60	2,9 %	2,4 %
61 a 90	3,0 %	2,5 %
91 a 180	4,4 %	4,2 %
> 180	4,9 %	5,1 %
Total	3,9 %	2,9 %

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	18 al 22 de Noviembre				25 al 29 de Noviembre				2 al 6 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	47	61	207	228	32	54	313	267	30	41	225	141
Real	26	12	110	89	28	6	60	107	13	3	62	146
Total	73	73	317	317	61	61	374	374	43	43	287	287

* 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 20 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.