

21 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\$99,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	19,8	12,1	2,1	9,8	21,9
15 a 35	15,0	17,2	10,2	8,0	25,2
36 a 60	9,0	24,8	15,8	-	24,8
61 a 90	7,0	8,0	1,0	-	8,0
91 a 180	3,7	10,4	6,7	-	10,4
> 180	-	9,2	9,2	-	9,2
Total	54,4	81,7	45,0	17,8	99,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	227	50	66	315	269	36	52	230	141
Real	26	12	109	89	30	14	62	108	19	4	62	151
Total	73	73	316	316	80	80	377	377	55	55	292	292

* 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 22 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.