

26 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\$74,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	13,9	13,2	0,1	0,8	14,0
15 a 35	26,5	32,5	9,8	3,8	36,3
36 a 60	0,3	-	-	0,3	0,3
61 a 90	8,1	3,9	0,9	5,1	9,0
91 a 180	7,2	7,5	7,5	7,2	14,7
> 180	-	0,4	0,4	-	0,4
Total	56,0	57,5	18,7	17,2	74,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	25 al 29 de Noviembre				2 al 6 de Diciembre				9 al 13 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	74	84	321	279	43	55	255	190	42	99	184	140
Real	31	20	67	109	19	7	86	151	59	3	63	106
Total	104	104	388	388	62	62	341	341	101	101	246	246

* 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 27 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.