

27 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\$143,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	3,0	-	-	3,0	3,0
15 a 35	25,7	79,5	58,0	4,2	83,7
36 a 60	13,1	22,0	10,0	1,1	23,1
61 a 90	7,3	7,6	2,6	2,3	9,9
91 a 180	3,3	3,0	-	0,3	3,3
> 180	20,7	9,0	-	11,7	20,7
Total	73,0	121,2	70,7	22,5	143,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	0,1 %	-13,2 %
15 a 35	4,1 %	6,2 %
36 a 60	2,4 %	2,2 %
61 a 90	4,5 %	5,1 %
91 a 180	4,0 %	7,1 %
> 180	4,2 %	5,8 %
Total	3,4 %	5,0 %

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	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	311	269	46	55	255	190	42	139	185	147
Real	31	20	67	109	19	10	86	151	99	3	68	107
Total	104	104	378	378	65	65	341	341	142	142	253	253

* 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 28 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.