

28 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\$91,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 14,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	13,5	21,5	10,0	2,0	23,5
15 a 35	4,0	55,1	53,1	2,0	57,1
36 a 60	1,1	0,2	0,2	1,1	1,3
61 a 90	4,4	5,3	5,3	4,4	9,7
91 a 180	-	-	-	-	-
> 180	-	-	-	-	-
Total	23,0	82,0	68,5	9,5	91,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	9,6 %	28,3 %
15 a 35	3,8 %	10,7 %
36 a 60	0,3 %	1,4 %
61 a 90	2,5 %	3,9 %
91 a 180	0,0 %	-
> 180	-	-
Total	5,5 %	14,4 %

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	51	59	262	207	43	139	186	148
Real	31	20	67	109	19	12	96	151	99	3	68	107
Total	104	104	378	378	70	70	358	358	142	142	254	254

* 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 29 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.