

28 de Octubre 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\$70,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	1,1	1,0	0,5	0,6	1,6
15 a 35	26,8	28,0	1,7	0,6	28,6
36 a 60	1,3	5,0	4,0	0,3	5,3
61 a 90	11,1	0,5	0,0	10,6	11,1
91 a 180	0,0	18,7	18,7	0,0	18,7
> 180	0,6	4,4	4,4	0,6	5,0
Total	40,9	57,7	29,5	12,6	70,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sectores	28 de Oct. al 1 de Noviembre				5 al 8 de Noviembre				12 al 15 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	42	58	198	198	52	58	237	182	17	24	124	100
Real	22	6	77	77	18	13	69	124	15	7	38	62
Total	64	64	275	275	71	71	306	306	31	31	162	162

* 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 octubre se presenta la proyección de vencimientos.