

30 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\$93,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	2,1	10,6	9,6	1,1	11,7
15 a 35	41,7	47,2	18,6	13,1	60,3
36 a 60	9,0	9,1	8,6	8,5	17,6
61 a 90	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
91 a 180	0,1	0,1	0,1	0,1	0,2
> 180	2,0	1,4	1,4	2,0	3,4
Total	54,9	68,3	38,2	24,8	93,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	204	198	55	70	238	190	17	25	130	102
Real	22	6	77	83	29	13	77	125	15	7	38	66
Total	64	64	281	281	84	84	315	315	32	32	168	168

* 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 31 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.