

29 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\$162,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	49,7	48,7	4,5	5,5	54,2
15 a 35	28,6	31,4	5,4	2,6	34,0
36 a 60	10,6	3,0	-	7,6	10,6
61 a 90	47,9	-	-	47,9	47,9
91 a 180	12,5	0,2	0,2	12,5	12,7
> 180	2,0	1,0	1,0	2,0	3,0
Total	151,3	84,3	11,1	78,1	162,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sectores	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	80	84	281	246	43	140	195	158
Real	31	20	67	109	19	15	116	151	99	3	72	109
Total	104	104	378	378	99	99	397	397	143	143	267	267

* 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 2 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.