

Fecha de publicación: 10 de Marzo 2003
 Fecha de Información: 6 de Marzo 2003 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\$44.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	6.2	1.0	-	5.2	6.2
15 a 35	14.2	8.2	2.4	8.4	16.6
36 a 60	-	0.1	0.1	-	0.1
61 a 90	0.2	0.3	0.2	-	0.3
91 a 180	4.1	6.1	2.1	0.1	6.2
>180	0.5	15.0	15.0	0.5	15.5
Total	25.1	30.7	19.8	14.1	44.9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	4.0 %	5.1 %
15 a 35	4.7 %	5.1 %
36 a 60	6.0 %	6.0 %
61 a 90	5.9 %	5.9 %
91 a 180	6.3 %	6.3 %
>180	7.0 %	7.1 %
Total	5.5 %	5.9 %

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	3 al 7 de Marzo				10 al 14 de Marzo				17 al 21 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	39	41	209	184	22	25	284	199	10	24	255	180
Real	12	10	25	50	20	17	29	114	21	8	43	117
Total	51	51	234	234	42	42	312	312	31	31	297	297

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (\text{Plazo}/365)) - 1$

³ A partir del 7 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.

TABLA DE PLAZOS Y CANTIDAD DE PESOS
OPERACIONES ENTRE EL 3 DE FEBRERO DE 2003 Y EL 28 DE FEBRERO 2003

Plazo (días calendario al vencimiento)	CANTIDAD DE PESOS
7	1.8
25	7.8
48	17.1
76	37.3
136	75.9
226	111.6
316	140.5

Nota: Para el cálculo de la cantidad de pesos sólo se consideran las operaciones de compra de los Intermediarios del Mercado Cambiario (IMC) al sector real realizadas en las cuatro semanas anteriores y reportadas al viernes 7 de Marzo de 2003. Se excluyen las operaciones entre un IMC y una empresa del sector real que pertenezca al mismo grupo empresarial.