

Fecha de publicación: 13 de Enero 2003
 Fecha de Información: 9 de Enero de 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\$103 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 01%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	6.6	21.1	21.1	6.6	27.7
15 a 35	18.9	27.0	12.0	3.9	30.9
36 a 60	0.3	0.5	0.3	0.1	0.6
61 a 90	20.1	-	-	20.1	20.1
91 a 180	8.3	8.7	0.7	0.3	9.0
>180	15.1	-	-	15.1	15.1
Total	69.4	57.3	34.0	46.1	103.4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	4.1 %	-5.5 %
15 a 35	2.5 %	1.8 %
36 a 60	2.5 %	1.8 %
61 a 90	2.1 %	2.1 %
91 a 180	4.0 %	3.8 %
>180	5.2 %	5.7 %
Total	3.2 %	0.6 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

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 10 de enero se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	6 al 10 de Enero				13 al 17 de Enero				20 al 24 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	72	86	299	264	74	68	336	311	44	36	246	158
Real	34	20	108	143	39	44	163	189	21	29	75	164
Total	106	106	407	407	112	112	500	500	65	65	322	322

* Cifras en millones de dólares

TABLA DE PLAZOS Y CANTIDAD DE PESOS
OPERACIONES ENTRE EL 9 DE DICIEMBRE DE 2002 Y EL 3 DE ENERO 2003

Plazo (Días calendario al vencimiento)	Cantidad de pesos
7	1.3
25	5.6
48	14.8
76	26.8
136	40.6
226	92.1
316	149.6

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 hasta hoy. Se excluyen las operaciones entre un IMC y una empresa del sector real que pertenezca al mismo grupo empresarial.

La cantidad de pesos para cada plazo es un promedio ponderado por monto de la diferencia en pesos entre la tasa pactada de las operaciones en el rango cercano a dicho plazo, y el promedio del sistema Datatec del día de la negociación. No se incluyen las operaciones con plazo superior a un año.