

Fecha de publicación: 29 de Enero 2003
 Fecha de Información: 27 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\$140 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 58%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	21.5	86.5	67.5	2.5	89.0
15 a 35	25.1	20.3	5.0	9.8	30.1
36 a 60	16.3	0.2	0.2	16.3	16.5
61 a 90	-	0.2	0.2	-	0.2
91 a 180	4.0	4.0	0.0	-	4.0
>180	-	-	-	-	-
Total	66.9	111.2	72.9	28.6	139.8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	26.5 %	87.0 %
15 a 35	6.8 %	6.7 %
36 a 60	4.9 %	5.4 %
61 a 90	4.7 %	4.7 %
91 a 180	5.6 %	6.0 %
>180	-	-
Total	11.2 %	57.6 %

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

Sector	27 al 31 de Enero				3 al 7 de Febrero				10 al 14 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	48	93	254	250	15	31	223	160	46	82	268	204
Real	56	11	107	110	19	3	27	89	44	8	70	134
Total	104	104	360	360	34	34	250	250	90	90	338	338

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

TABLA DE PLAZOS Y CANTIDAD DE PESOS
OPERACIONES ENTRE EL 23 DE DICIEMBRE DE 2002 Y EL 17 DE ENERO 2003

Plazo (días calendario al vencimiento)	CANTIDAD DE PESOS
7	-1.0
25	4.6
48	15.0
76	14.4
136	47.0
226	81.2
316	166.3

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 24 de enero de 2003. 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 SET FX (Sistema electrónico de Transacciones FX), del día de la negociación. No se incluyen las operaciones con plazo superior a un año.