

Fecha de publicación: 30 de Enero 2003  
 Fecha de Información: 28 de Enero de 2003 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$39 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 05%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	5.2	0.0	0.0	5.2	5.3
15 a 35	17.6	9.5	0.5	8.6	18.1
36 a 60	0.5	0.0	0.0	0.5	0.5
61 a 90	14.1	0.1	0.1	14.1	14.2
91 a 180	0.6	0.0	0.0	0.6	0.6
>180	0.2	-	-	0.2	0.2
<b>Total</b>	<b>38.1</b>	<b>9.7</b>	<b>0.7</b>	<b>29.1</b>	<b>38.8</b>

\* Cifras en millones de dólares

**Cuadro No. 2**  
**Devaluación Implícita Anualizada**

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	4.2 %	15.5 %
15 a 35	2.8 %	1.6 %
36 a 60	2.5 %	0.8 %
61 a 90	3.4 %	5.4 %
91 a 180	4.5 %	4.1 %
>180	2.6 %	2.6 %
<b>Total</b>	<b>3.3 %</b>	<b>4.9 %</b>

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

**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
<b>Interbancario</b>	48	93	254	250	17	31	226	160	46	82	271	204
<b>Real</b>	56	12	107	110	19	4	27	92	44	8	70	136
<b>Total</b>	105	105	361	361	35	35	253	253	90	90	341	341

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

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

<b>Plazo (días calendario al vencimiento)</b>	<b>CANTIDAD DE PESOS</b>
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.