

Fecha de publicación: 31 de Enero 2003
 Fecha de Información: 29 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\$55 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 03%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	4.8	0.2	0.1	4.7	4.9
15 a 35	10.9	8.7	3.4	5.6	14.3
36 a 60	2.1	4.7	2.7	0.1	4.8
61 a 90	5.0	1.1	1.1	5.0	6.1
91 a 180	22.4	3.4	1.4	20.4	23.9
>180	-	1.5	1.5	-	1.5
Total	45.2	19.6	10.2	35.9	55.4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-7.5 %	-8.6 %
15 a 35	-0.1 %	-0.8 %
36 a 60	3.7 %	6.6 %
61 a 90	5.7 %	5.4 %
91 a 180	5.5 %	5.4 %
>180	6.5 %	6.5 %
Total	1.3 %	2.7 %

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	19	31	228	160	47	82	275	204
Real	56	12	107	110	19	6	27	94	44	9	70	140
Total	105	105	361	361	38	38	255	255	91	91	345	345

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

**TABLA DE PLAZOS Y CANTIDAD DE PESOS
OPERACIONES ENTRE EL 30 DE DICIEMBRE DE 2002 Y EL 24 DE ENERO 2003**

Plazo (días calendario al vencimiento)	CANTIDAD DE PESOS
7	-1.1
25	6.9
48	17.9
76	13.9
136	43.7
226	80.4
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 31 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.