

Fecha de publicación: 10 de Enero 2003
Fecha de Información: 8 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\$114.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	43.4	27.0	6.0	22.4	49.5
15 a 35	40.8	44.7	10.0	6.1	50.8
36 a 60	-	0.2	0.2	-	0.2
61 a 90	9.1	9.3	0.3	0.1	9.4
91 a 180	-	0.0	0.0	-	0.0
> 180	5.0	-	-	5.0	5.0
Total	98.3	81.3	16.6	33.6	114.9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	4.3 %	2.3 %
15 a 35	3.9 %	6.9 %
36 a 60	7.4 %	7.4 %
61 a 90	4.9 %	4.2 %
91 a 180	7.0 %	7.0 %
> 180	5.4 %	5.4 %
Total	4.3 %	4.6 %

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

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	297	262	69	47	334	308	42	36	243	158
Real	34	20	106	141	18	39	163	189	21	27	75	160
Total	106	106	404	404	87	87	497	497	63	63	318	318

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Promedio Datatec}) ^ (\text{Plazo} / 360)) - 1$

³ A partir del 9 de enero se presenta la proyección de vencimientos.

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.