

Fecha de publicación: 10 de Febrero 2003
 Fecha de Información: 6 de Febrero de 2003¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$72 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 06%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	12.8	5.8	0.2	7.2	12.9
15 a 35	18.5	18.5	1.0	1.0	19.5
36 a 60	12.5	17.5	5.0	-	17.5
61 a 90	11.0	16.5	5.5	-	16.5
91 a 180	4.5	4.1	0.1	0.5	4.6
>180	-	0.8	0.8	-	0.8
Total	59.3	63.2	12.6	8.7	71.9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-3.3 %	0.9 %
15 a 35	5.5 %	6.6 %
36 a 60	8.5 %	9.4 %
61 a 90	5.4 %	5.7 %
91 a 180	6.6 %	5.6 %
>180	7.1 %	7.3 %
Total	3.3 %	6.0 %

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	3 al 7 de Febrero				10 al 14 de Febrero				17 al 21 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	25	32	257	222	59	105	313	239	20	32	302	209
Real	19	13	62	96	60	14	75	149	18	6	35	128
Total	44	44	319	319	119	119	388	388	39	39	337	337

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

**TABLA DE PLAZOS Y CANTIDAD DE PESOS
OPERACIONES ENTRE EL 7 DE ENERO DE 2003 Y EL 31 DE ENERO 2003**

Plazo (días calendario al vencimiento)	CANTIDAD DE PESOS
7	-0.8
25	3.2
48	21.1
76	25.4
136	49.9
226	78.9
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 7 de Febrero de 2003. Se excluyen las operaciones entre un IMC y una empresa del sector real que pertenezca al mismo grupo empresarial.