

Fecha de publicación: 11 de Febrero 2003  
 Fecha de Información: 7 de Febrero 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\$66 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 02%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	15.2	10.2	0.2	5.2	15.4
15 a 35	24.0	24.0	1.0	1.0	25.0
36 a 60	12.8	12.1	0.1	0.8	12.9
61 a 90	-	5.5	5.5	-	5.5
91 a 180	6.2	5.7	0.7	1.2	6.8
>180	0.3	0.2	0.2	0.3	0.5
<b>Total</b>	<b>58.5</b>	<b>57.6</b>	<b>7.6</b>	<b>8.5</b>	<b>66.1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-4.5 %	-7.1 %
15 a 35	2.4 %	2.9 %
36 a 60	4.5 %	5.3 %
61 a 90	5.0 %	5.2 %
91 a 180	5.8 %	6.0 %
>180	6.5 %	6.1 %
<b>Total</b>	<b>2.3 %</b>	<b>1.6 %</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	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
<b>Interbancario</b>	25	32	257	222	62	105	323	249	23	32	302	209
<b>Real</b>	19	13	62	96	60	17	75	149	18	9	35	128
<b>Total</b>	44	44	319	319	122	122	398	398	41	41	337	337

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

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

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