

Fecha de publicación: 21 de Febrero 2003
Fecha de Información: 19 de Febrero 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\$140 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	17.0	28.3	14.3	3.0	31.3
15 a 35	65.3	28.1	9.1	46.3	74.4
36 a 60	0.1	0.2	0.2	0.1	0.3
61 a 90	17.0	8.1	3.1	12.0	20.1
91 a 180	3.0	7.7	4.7	-	7.7
>180	0.2	6.4	6.4	0.2	6.6
Total	102.6	78.8	37.8	61.6	140.4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	3.5 %	3.2 %
15 a 35	4.3 %	4.6 %
36 a 60	5.0 %	4.9 %
61 a 90	5.4 %	5.6 %
91 a 180	6.2 %	6.2 %
>180	6.3 %	6.6 %
Total	5.0 %	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	17 al 21 de Febrero				24 al 28 de Febrero				3 al 7 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	33	34	336	253	16	46	323	277	13	23	176	156
Real	19	18	51	133	37	7	107	154	12	2	21	41
Total	52	52	387	387	53	53	431	431	25	25	197	197

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (Plazo/365)) - 1

³ A partir del 20 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.

**TABLA DE PLAZOS Y CANTIDAD DE PESOS
OPERACIONES ENTRE EL 20 DE ENERO DE 2003 Y EL 14 DE FEBRERO 2003**

Plazo (días calendario al vencimiento)	CANTIDAD DE PESOS
7	1.5
25	3.9
48	21.4
76	36.6
136	54.0
226	83.9
316	139.9

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 21 de Febrero de 2003. Se excluyen las operaciones entre un IMC y una empresa del sector real que pertenezca al mismo grupo empresarial.