

Fecha de publicación: 28 de Febrero 2003
 Fecha de Información: 26 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\$62 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	11.0	12.2	2.0	0.8	13.0
15 a 35	30.9	32.8	9.3	7.4	40.1
36 a 60	5.0	-	-	5.0	5.0
61 a 90	4.0	4.0	-	-	4.0
91 a 180	-	-	-	-	-
>180	-	-	-	-	-
Total	50.9	49.0	11.3	13.2	62.1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	4.0 %	10.8 %
15 a 35	5.6 %	6.1 %
36 a 60	5.0 %	5.0 %
61 a 90	6.1 %	6.1 %
91 a 180	-	-
>180	-	-
Total	5.2 %	7.0 %

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

Sectores	24 al 28 de Febrero				3 al 7 de Marzo				10 al 14 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	20	52	341	292	26	33	190	166	19	25	247	170
Real	42	10	111	161	12	6	23	47	20	15	26	103
Total	62	62	453	453	39	39	213	213	39	39	272	272

* 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 27 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.

**TABLA DE PLAZOS Y CANTIDAD DE PESOS
OPERACIONES ENTRE EL 27 DE ENERO DE 2003 Y EL 21 DE FEBRERO 2003**

Plazo (días calendario al vencimiento)	CANTIDAD DE PESOS
7	1.6
25	4.9
48	22.9
76	37.5
136	58.8
226	92.3
316	139.1

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