

Fecha de publicación: 11 de Marzo 2003

Fecha de Información: 7 de Marzo 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\$64.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	6.0	2.3	0.1	3.8	6.1
15 a 35	18.3	8.3	1.3	11.3	19.6
36 a 60	9.8	15.1	6.1	0.8	16.0
61 a 90	2.0	2.0	0.0	-	2.0
91 a 180	10.0	20.2	10.2	-	20.2
>180	-	0.1	0.1	-	0.1
Total	46.1	48.1	17.9	15.9	64.0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	3.5 %	4.7 %
15 a 35	4.6 %	5.0 %
36 a 60	5.5 %	6.7 %
61 a 90	5.7 %	5.8 %
91 a 180	6.3 %	6.4 %
>180	6.7 %	6.7 %
Total	5.1 %	5.9 %

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	3 al 7 de Marzo				10 al 14 de Marzo				17 al 21 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	39	41	209	184	23	25	286	201	12	24	257	180
Real	12	10	25	50	20	18	29	114	21	9	43	119
Total	51	51	234	234	43	43	314	314	33	33	299	299

* 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 10 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.

**TABLA DE PLAZOS Y CANTIDAD DE PESOS
OPERACIONES ENTRE EL 3 DE FEBRERO DE 2003 Y EL 28 DE FEBRERO 2003**

Plazo (días calendario al vencimiento)	CANTIDAD DE PESOS
7	1.8
25	7.8
48	17.1
76	37.3
136	75.9
226	111.6
316	140.5

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