

Fecha de publicación: 13 de Marzo 2003
Fecha de Información: 11 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\$59.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	11.1	5.0	-	6.1	11.1
15 a 35	8.4	5.3	0.2	3.3	8.6
36 a 60	12.1	7.0	-	5.1	12.1
61 a 90	-	0.1	0.1	-	0.1
91 a 180	7.5	10.9	9.9	6.5	17.4
>180	10.3	0.1	0.1	10.3	10.4
Total	49.4	28.3	10.3	31.3	59.7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	-0.1 %	2.5 %
15 a 35	3.8 %	4.4 %
36 a 60	2.6 %	5.3 %
61 a 90	6.2 %	6.1 %
91 a 180	6.3 %	6.3 %
>180	7.3 %	7.7 %
Total	4.6 %	5.4 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (\text{Plazo}/365)) - 1$

³ A partir del 12 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	10 al 14 de Marzo				17 al 21 de Marzo				24 al 28 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Interbancario	25	25	286	199	13	25	269	186	19	23	165	154
Real	20	20	27	114	21	9	43	125	9	5	44	54
Total	45	45	313	313	34	34	311	311	28	28	209	209

* Cifras en millones de dólares

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.