

Fecha de publicación: 9 de Abril 2003
 Fecha de Información: 7 de Abril 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\$104.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	30.3	23.1	0.5	7.7	30.8
15 a 35	36.5	16.4	3.8	23.9	40.3
36 a 60	13.3	11.9	1.6	3.0	14.9
61 a 90	5.0	2.0	2.0	5.0	7.0
91 a 180	10.4	11.3	0.9	-	11.3
>180	-	0.3	0.3	-	0.3
Total	95.3	65.0	9.2	39.5	104.5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	6.2 %	6.4 %
15 a 35	5.1 %	4.6 %
36 a 60	5.9 %	6.2 %
61 a 90	5.8 %	5.3 %
91 a 180	6.8 %	6.4 %
>180	6.8 %	6.8 %
Total	5.8 %	5.6 %

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	7 al 11 de Abril				14 al 18 de Abril				21 al 25 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	18	20	371	266	15	29	178	120	10	26	211	174
Real	14	11	60	165	16	2	17	75	23	7	31	68
Total	32	32	431	431	31	31	195	195	33	33	242	242

* 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 8 de abril se presenta la proyección de vencimientos.

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

Plazo (días calendario al vencimiento)	CANTIDAD DE PESOS
7	2.7
25	8.1
48	19.7
76	27.4
136	45.3
226	93.5
316	152.4

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